

공시일	2026-09-30
기준일	2026-09-29

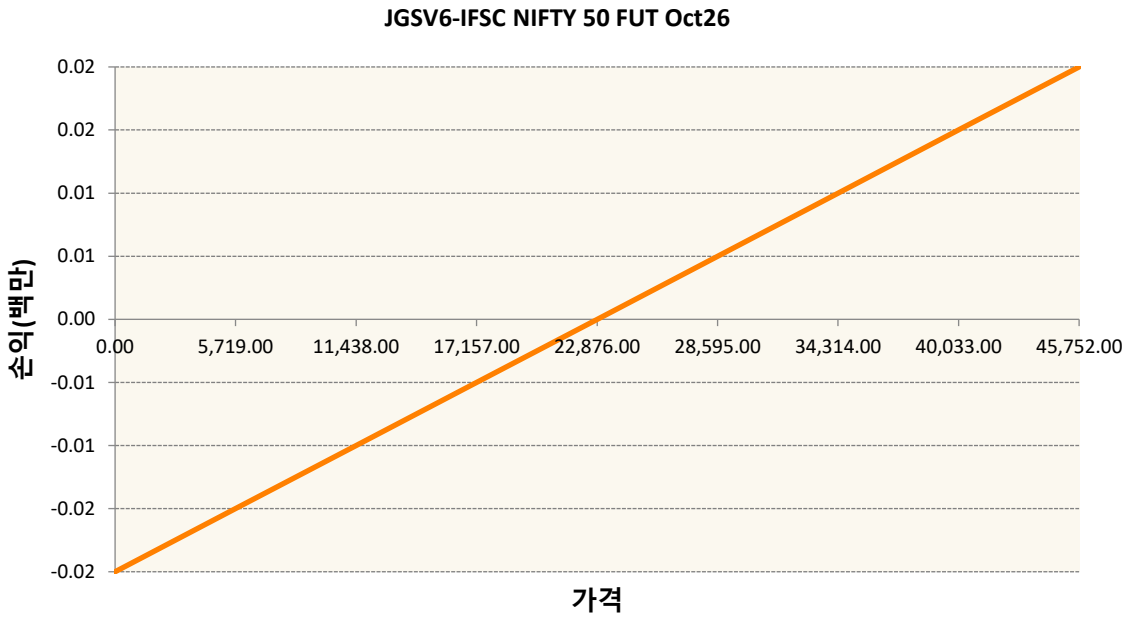
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	312	0	312	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSV6	IFSC NIFTY 50 FUT Oct26	25
-------	-------------------------	----

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

17

공시일	2026-09-30
기준일	2026-09-29

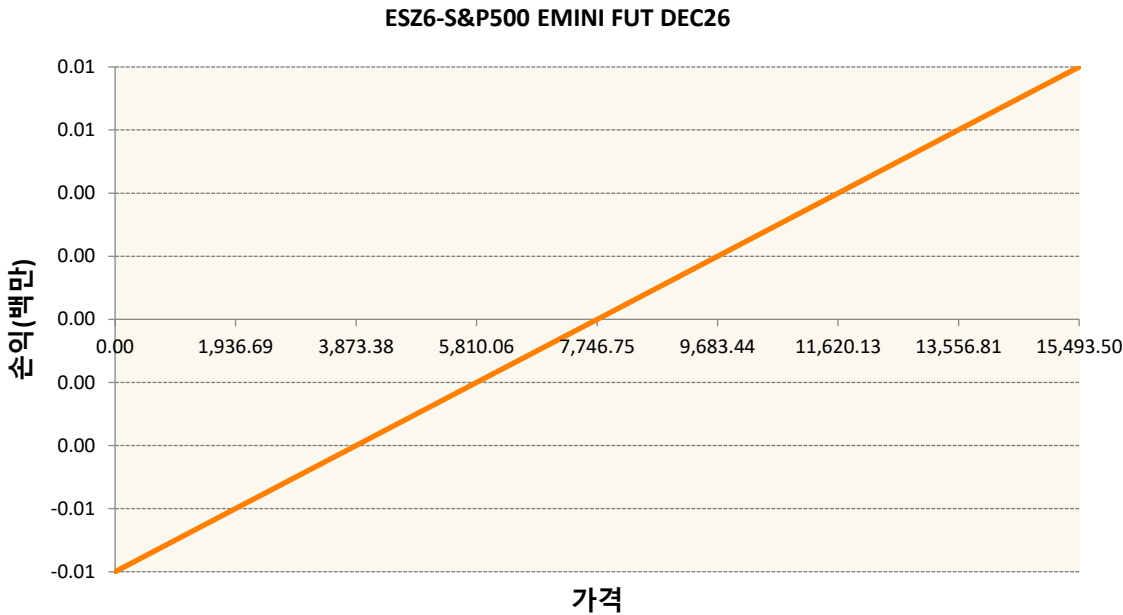
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	536	0	536	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESZ6	S&P500 EMINI FUT DEC26	43
------	------------------------	----

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

26

공시일	2026-09-30
기준일	2026-09-29

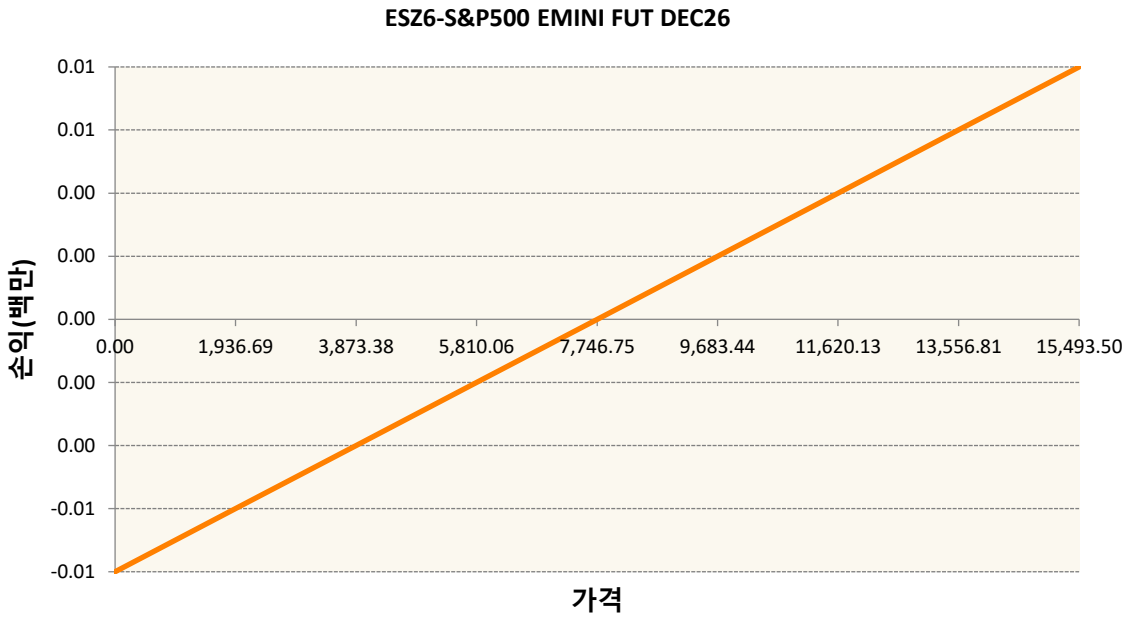
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	535	0	535	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESZ6	S&P500 EMINI FUT DEC26	43
------	------------------------	----

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

26

공시일	2026-09-30
기준일	2026-09-29

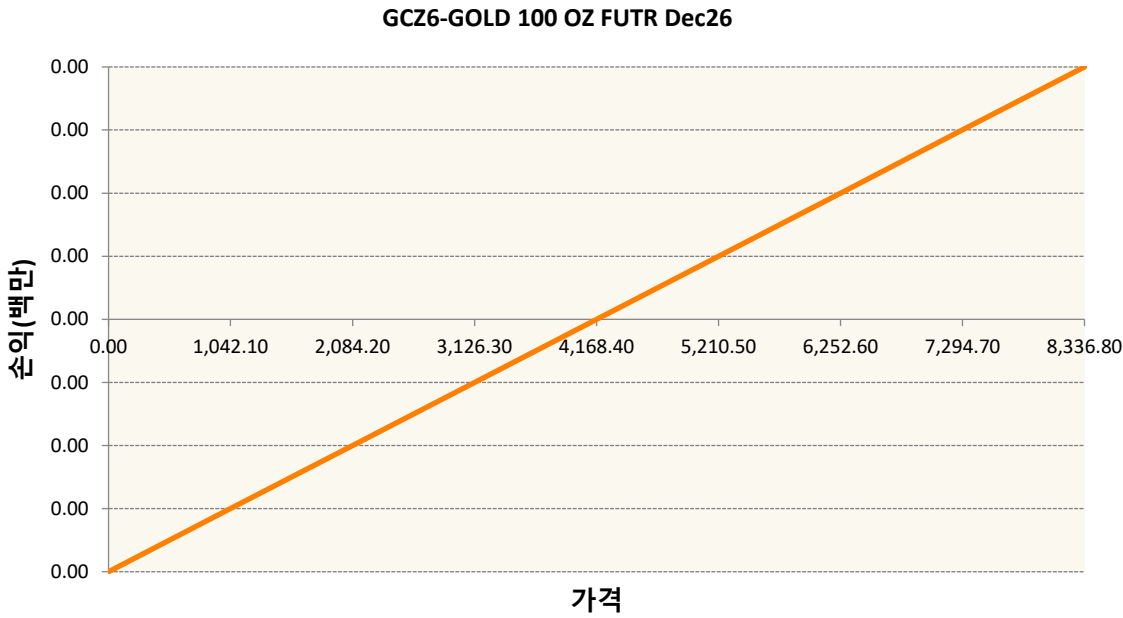
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규			0	0	0	
신규	실물자산	옵션	0	0	0	
누계			5,938	0	5,938	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC3 GLD US 10/02/26 C395 EQUITY	1
GCZ6 GOLD 100 OZ FUTR Dec26	475

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

618

공시일	2026-09-30
기준일	2026-09-29

SOL팔란티어커버드콜OTM채권혼합상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	
누계	유가증권	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOPLTRUBC PLTR US 10/02/26 C195 EQUITY	64
--	----

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

222

공시일	2026-09-30
기준일	2026-09-29

SOL팔란티어미국채커버드콜혼합상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	
누계	유가증권	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOTLTUSAC TLT US 10/02/26 C79.5 EQUITY

2

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

1

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

12,563

공시일 2026-09-30

기준일 2026-09-29

포커스채권(채권-파생형)(종)

1. 계약금액

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

2. 만기시점의 손익구조

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

공시일	2026-09-30
기준일	2026-09-29

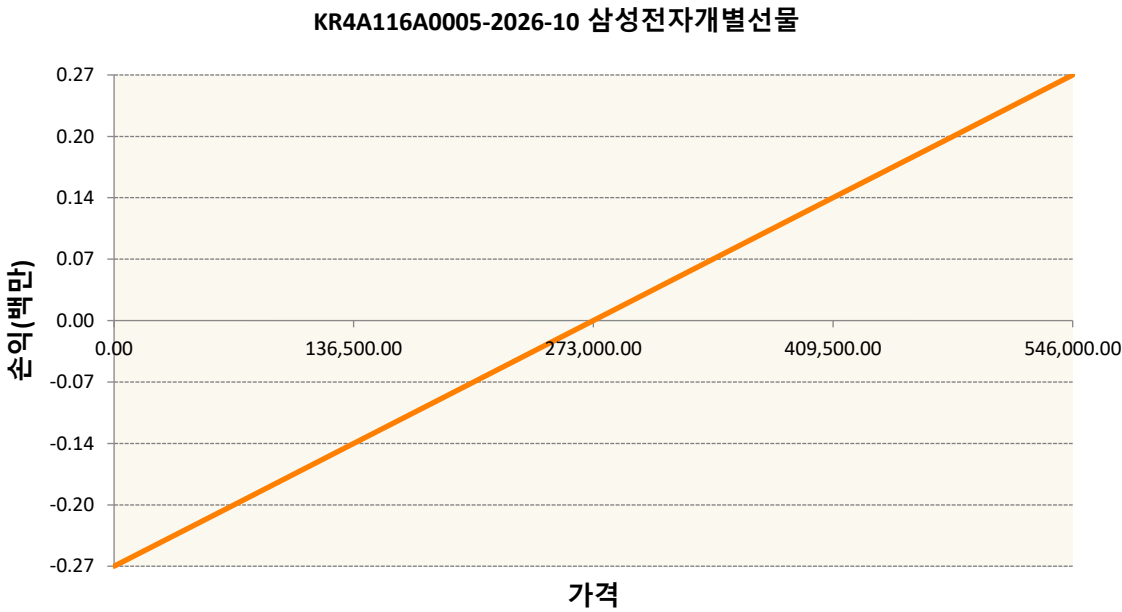
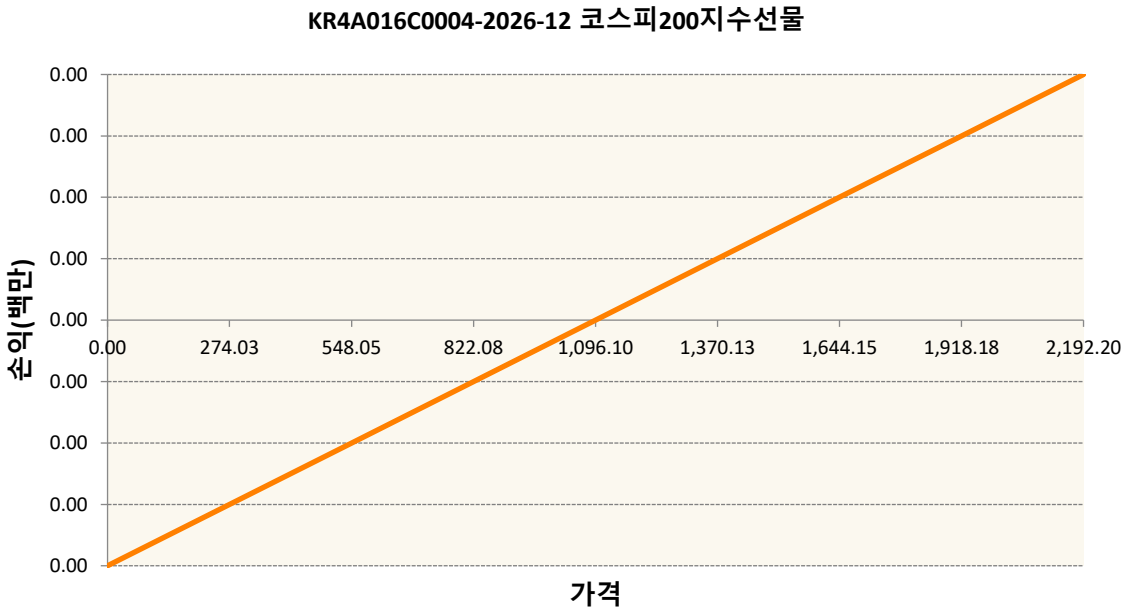
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	21,867	0	21,867	장내
누계	유가증권	옵션	0	74,905	-74,905	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph illustrates a linear relationship between price and profit/loss. The x-axis represents '가격' (Price) with values from 0.00 to 2,185.00. The y-axis represents '손익(백만)' (Profit/Loss in millions) with values from 0.00 to 0.00. An orange line starts at the origin (0,0) and extends to the point (1,092.50, 0.00).

가격	손익(백만)
0.00	0.00
273.13	0.00
546.25	0.00
819.38	0.00
1,092.50	0.00
1,365.63	0.00
1,638.75	0.00
1,911.88	0.00
2,185.00	0.00

The graph illustrates a linear relationship between the price (가액) and the net income (순이익). The x-axis represents the price, ranging from 0.00 to 2,190.00. The y-axis represents the net income in millions, ranging from 0.00 to 0.00. A single orange line starts at the origin (0, 0) and extends to the point (1,095.00, 0.00).

가액	순이익 (백만)
0.00	0.00
1,095.00	0.00

(단위:백만원)

KR4A016C0004				2026-12 코스피200지수선물				566
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-566	-566	-566	-566	-566	-566	-566	
-5.33%	-377	-377	-377	-377	-377	-377	-377	
-2.67%	-189	-189	-189	-189	-189	-189	-189	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	189	189	189	189	189	189	189	
5.33%	377	377	377	377	377	377	377	
8.00%	566	566	566	566	566	566	566	
KR4A116A0005				2026-10 삼성전자개별선물				1,177
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,177	-1,177	-1,177	-1,177	-1,177	-1,177	-1,177
-5.33%	-785	-785	-785	-785	-785	-785	-785
-2.67%	-392	-392	-392	-392	-392	-392	-392
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	392	392	392	392	392	392	392
5.33%	785	785	785	785	785	785	785
8.00%	1,177	1,177	1,177	1,177	1,177	1,177	1,177
KR4B09FFA380 코스피위클리 C 2610W1 1,092.5							3,065

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,053	-3,053	-3,054	-3,055	-3,057	-3,060	-3,065
-5.33%	-1,867	-1,871	-1,878	-1,887	-1,899	-1,913	-1,930
-2.67%	-732	-757	-786	-817	-850	-885	-922
0%	148	99	49	0	-50	-99	-149
2.67%	572	537	499	459	418	376	333
5.33%	675	665	652	635	615	593	568
8.00%	687	686	683	679	673	666	655
KR4B09FFA398 코스피위클리 C 2610W1 1,095.0							2,085

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,078	-2,078	-2,078	-2,079	-2,080	-2,082	-2,085
-5.33%	-1,281	-1,284	-1,288	-1,293	-1,300	-1,309	-1,319
-2.67%	-514	-529	-547	-566	-587	-610	-633
0%	98	66	33	0	-33	-66	-99
2.67%	408	383	356	329	300	271	241
5.33%	489	482	472	459	445	428	410
8.00%	499	498	496	493	489	483	475

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

15,871

공시일	2026-09-30
기준일	2026-09-29

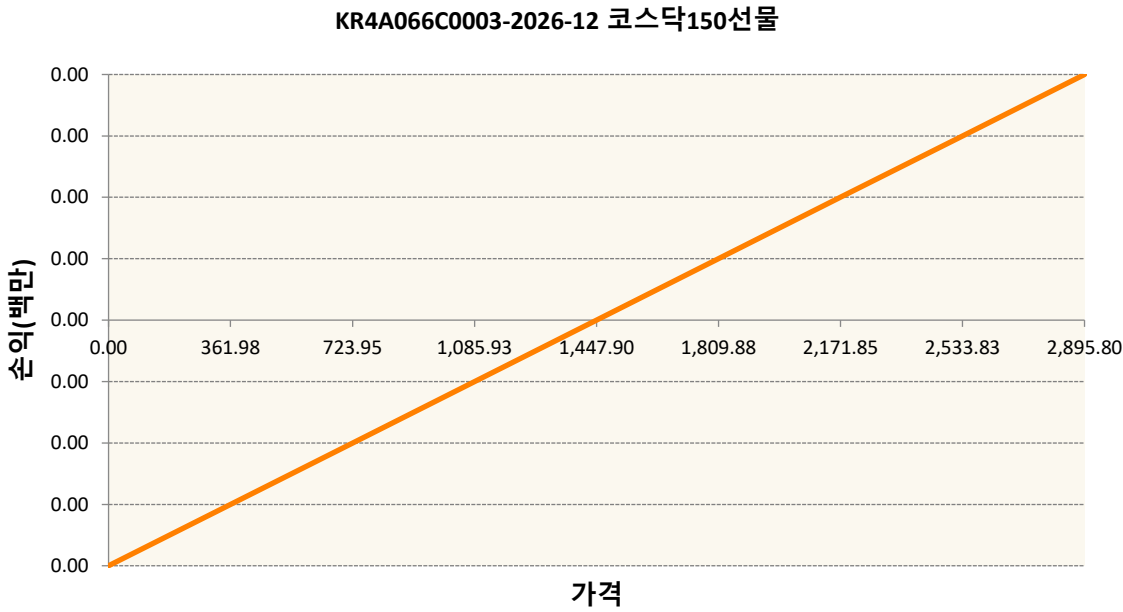
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	666	0	666	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A066C0003			2026-12 코스닥150선물				53
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
-5.33%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
-2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	18	18	18	18	18	18	18
5.33%	35	35	35	35	35	35	35
8.00%	53	53	53	53	53	53	53

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

12,587

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

87,756

공시일	2026-09-30
기준일	2026-09-29

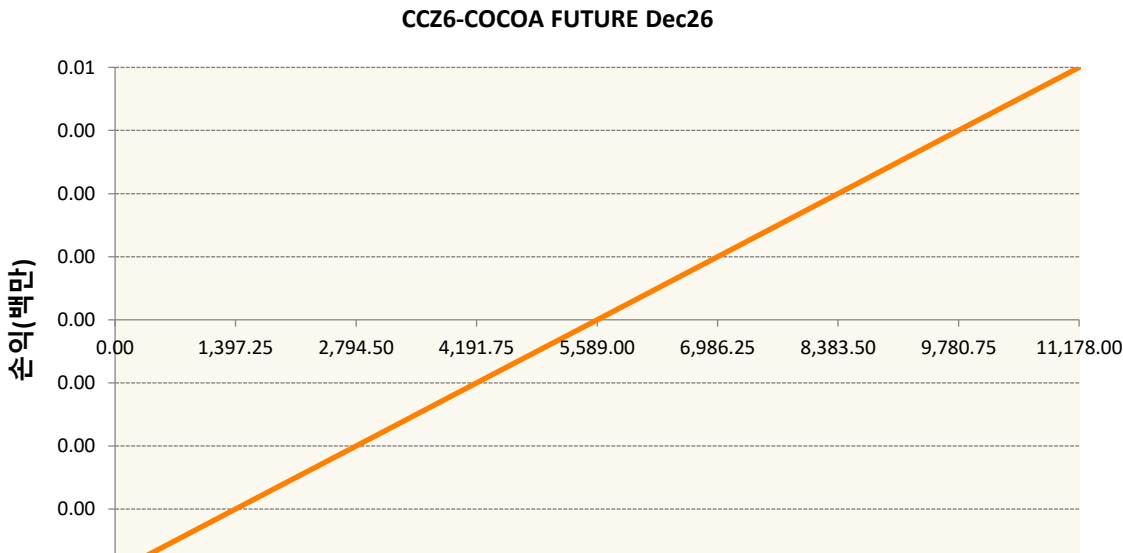
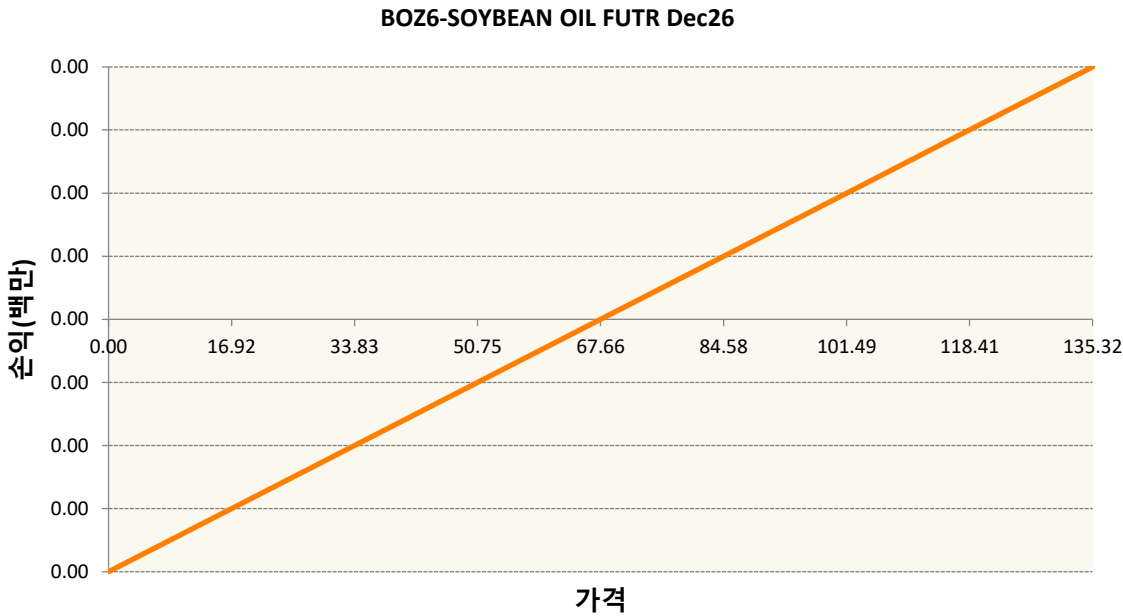
포커스농산물모(채권-파생형)

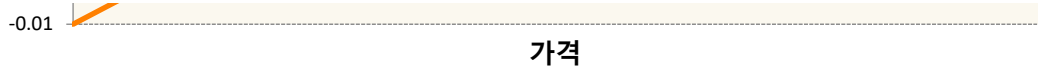
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	386	0	386	
누계	유가증권	선물	2,398	0	2,398	
누계	통화	선물	0	339	-339	장내

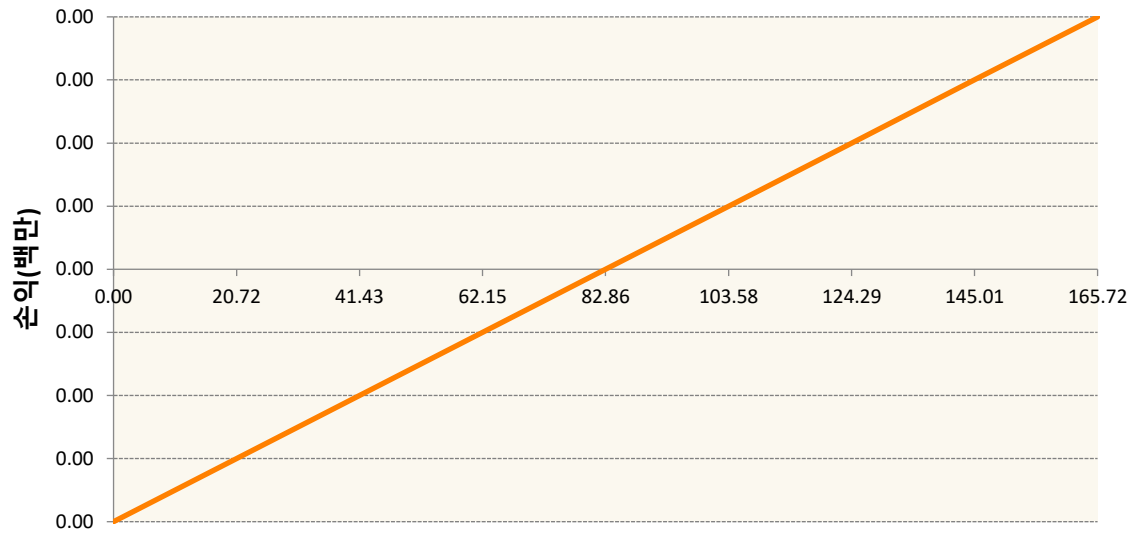
2. 만기시점의 손익구조





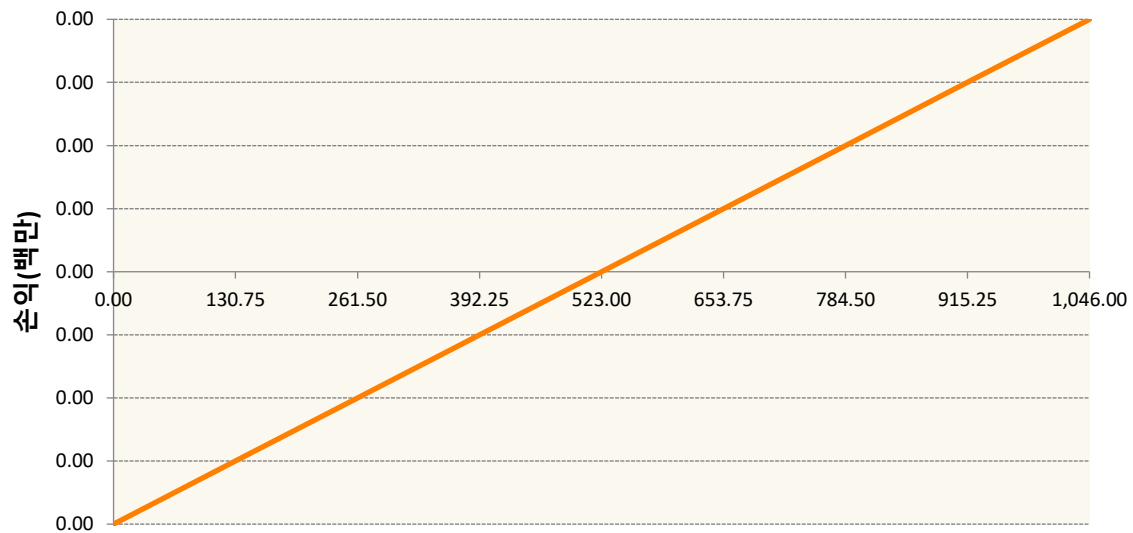
가격

CTZ6-COTTON NO.2 FUTR Dec26



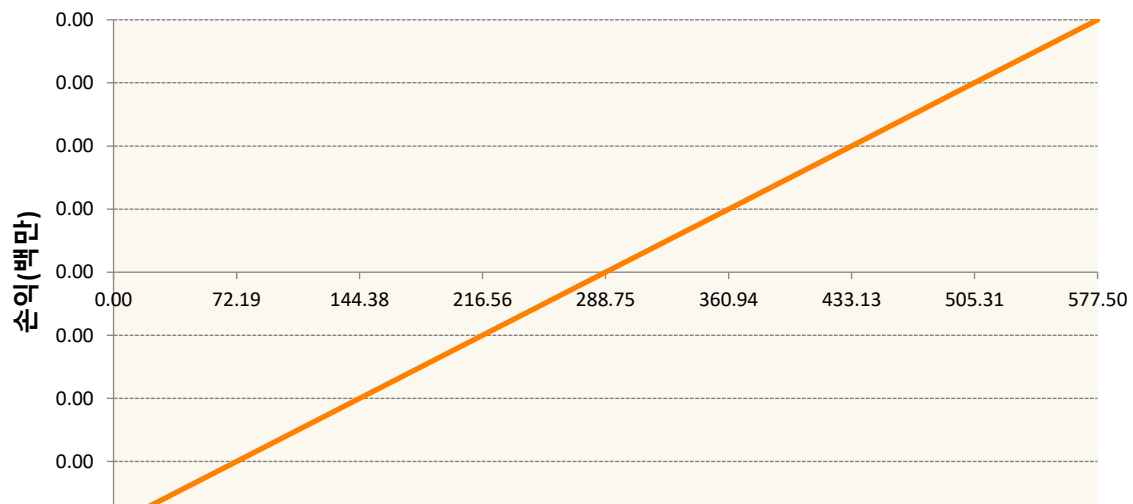
가격

CZ6-CORN FUTURE Dec26

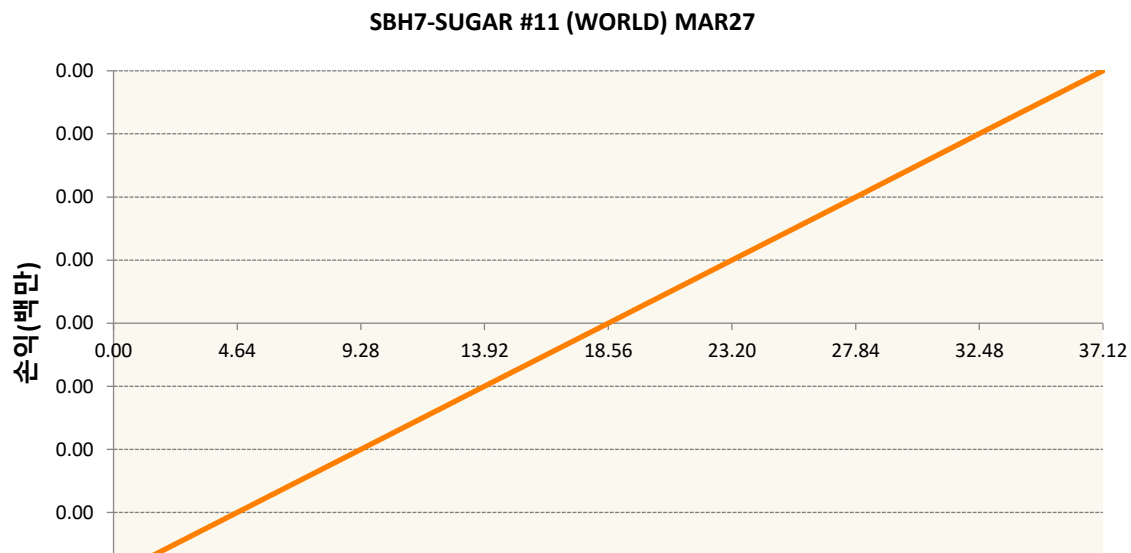
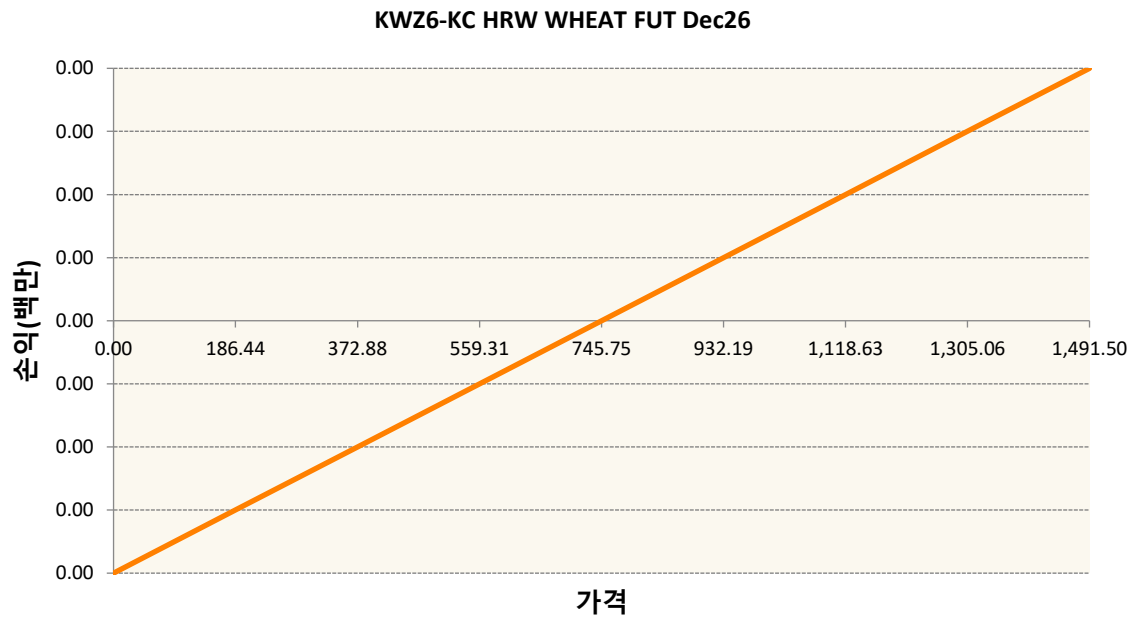
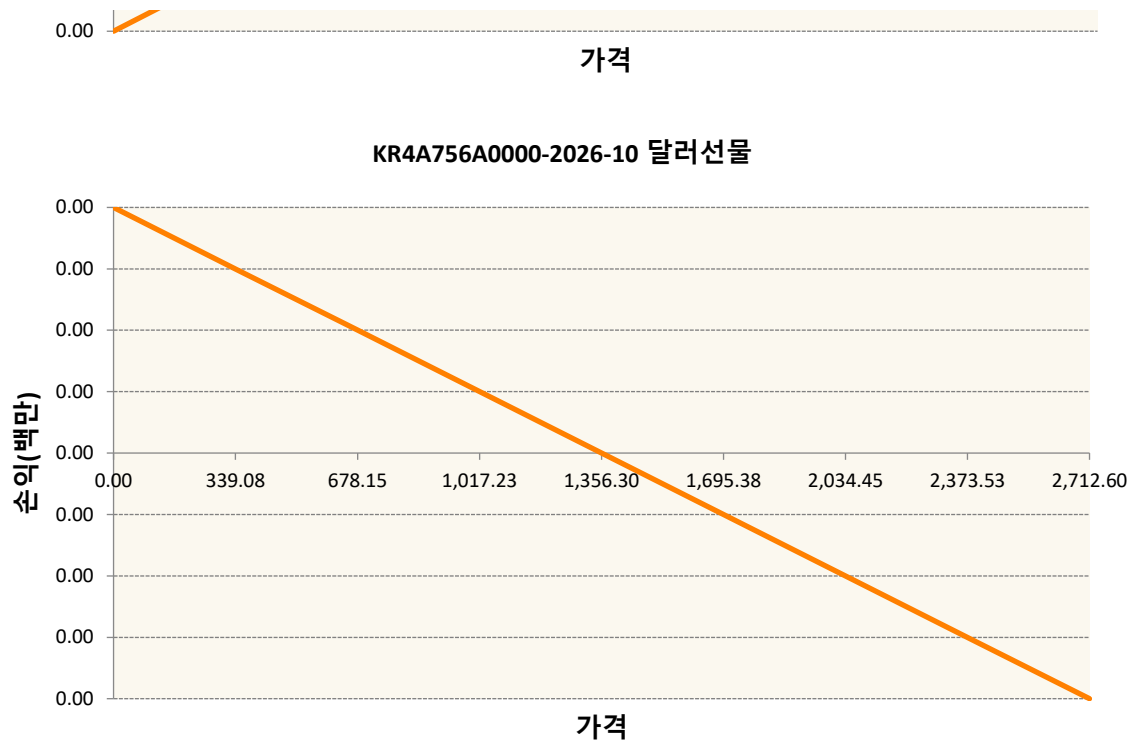


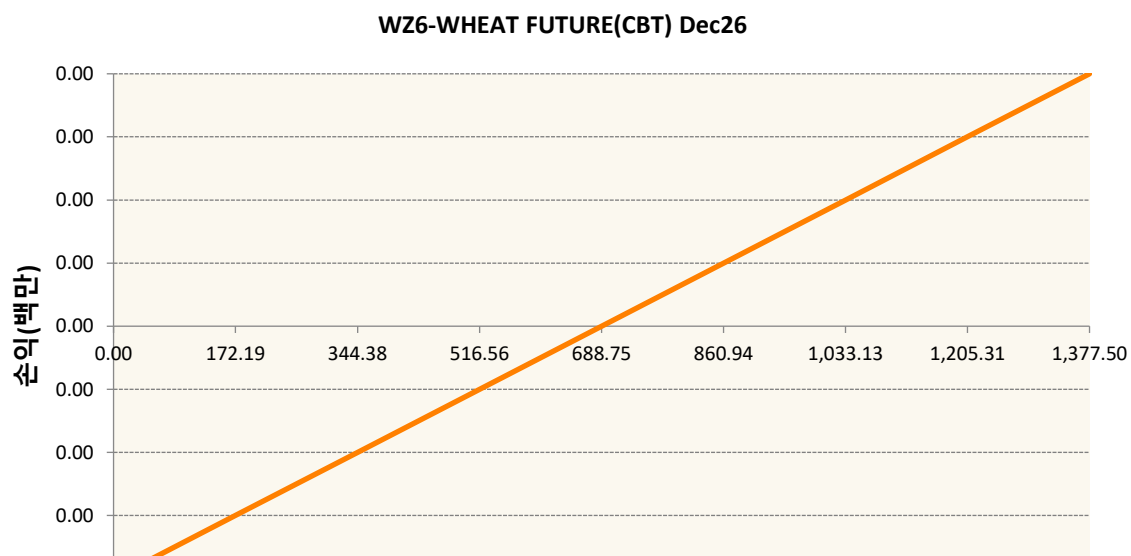
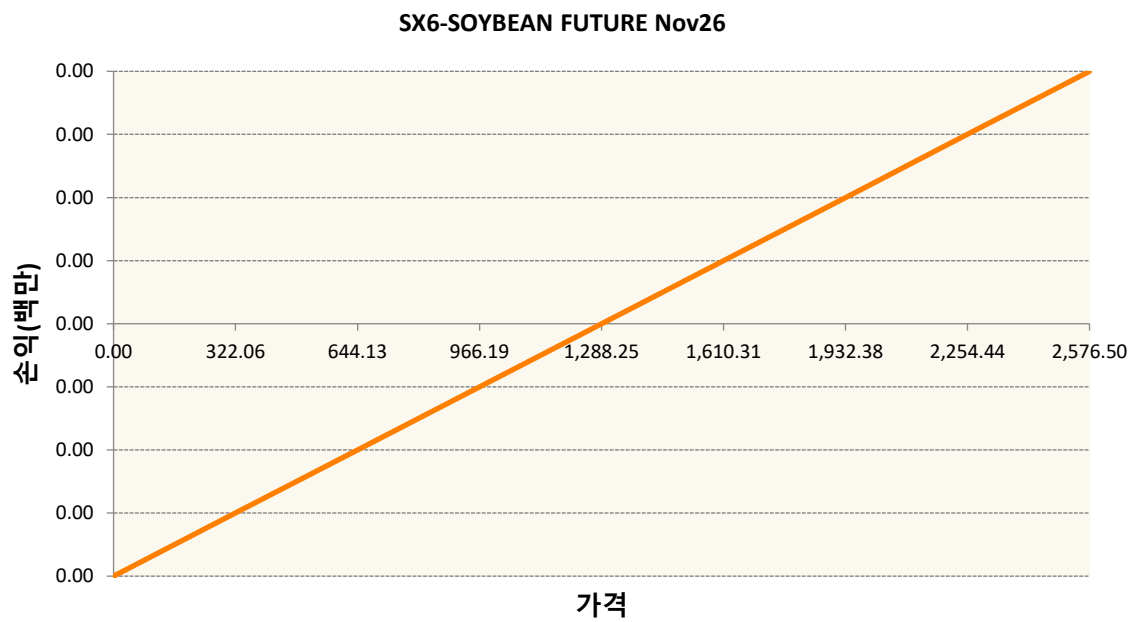
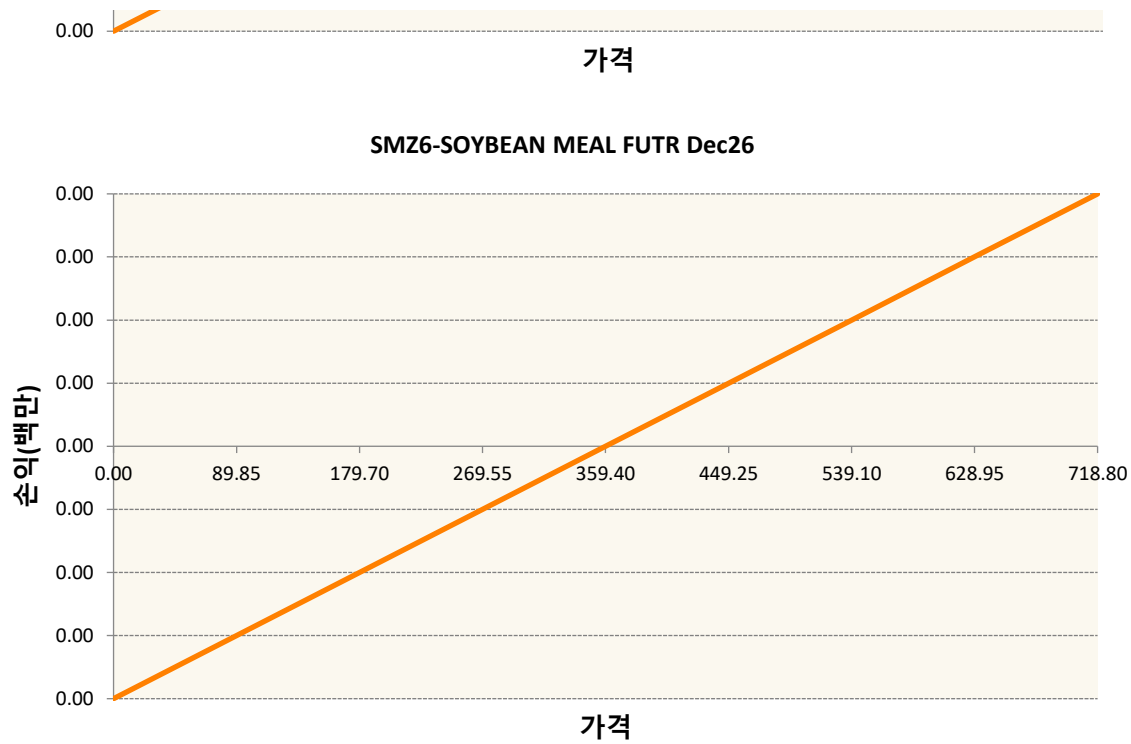
가격

KCZ6-COFFEE 'C' FUTURE Dec26



손익(백만)





0.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2026-09-30
기준일	2026-09-29

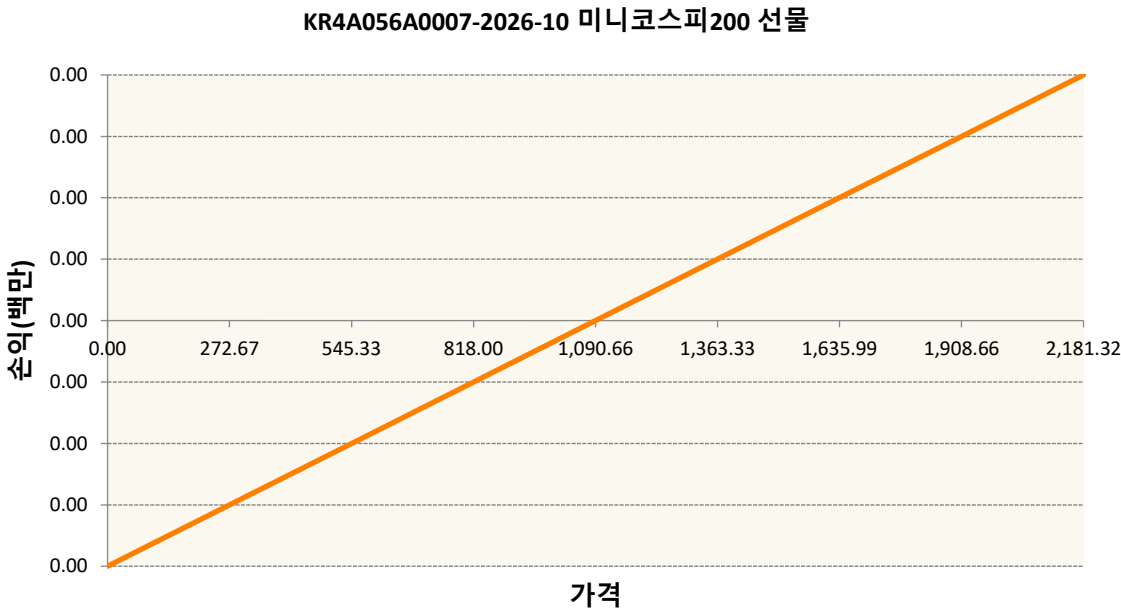
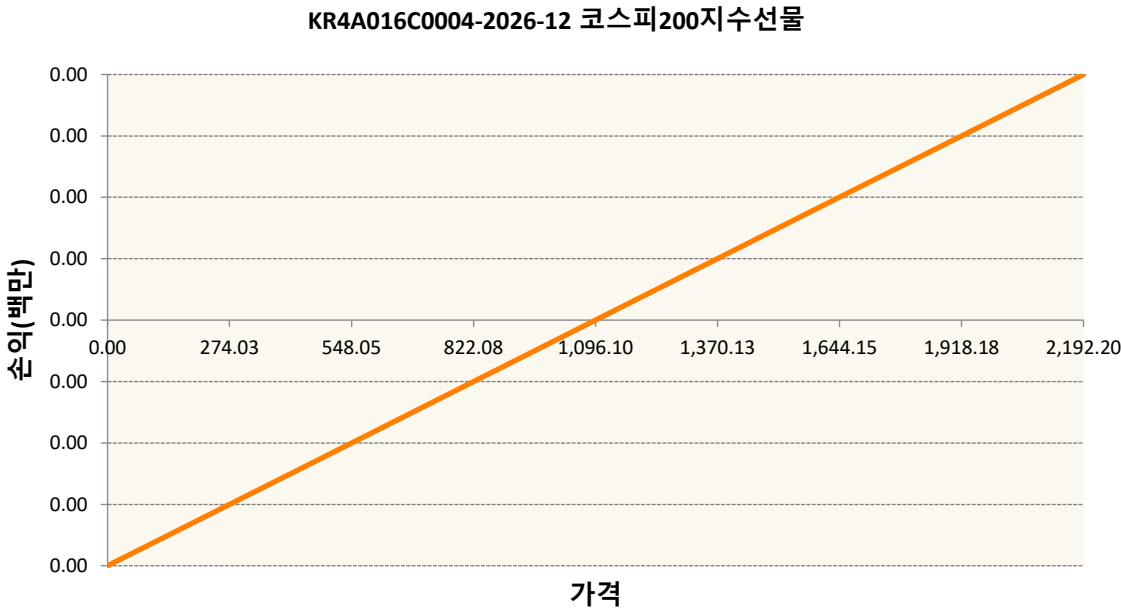
스마트인덱스모

1. 계약금액

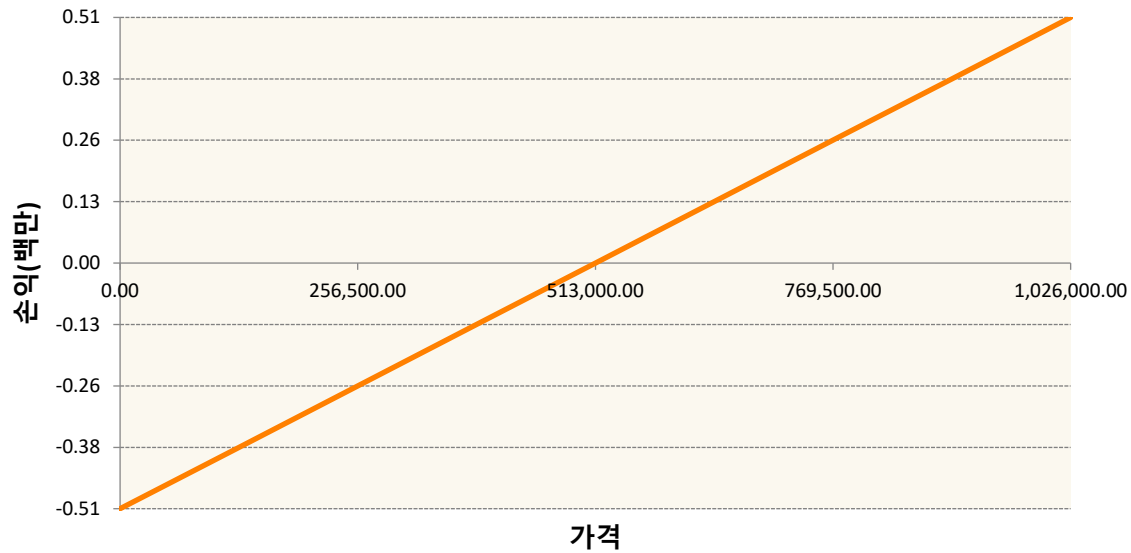
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	817	0	817	장내
누계	유가증권	선물	9,359	59	9,300	장내

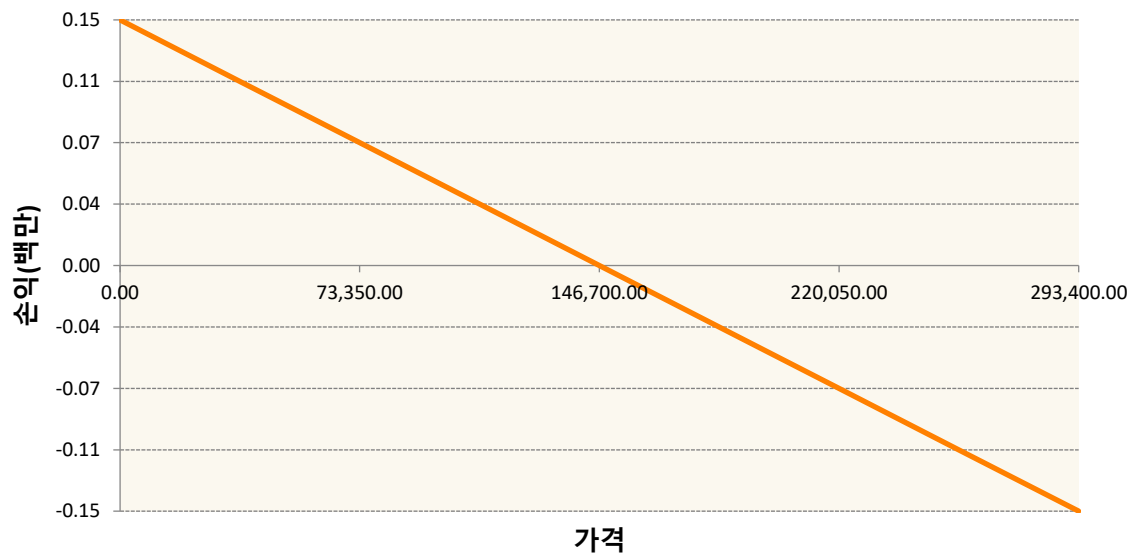
2. 만기시점의 손익구조



KR4A226A0002-2026-10 삼성SDI개별선물



KR4A416A0002-2026-10 SK이노베이션개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A016C0004				2026-12 코스피200지수선물			348
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-348	-348	-348	-348	-348	-348	-348
-5.33%	-232	-232	-232	-232	-232	-232	-232
-2.67%	-116	-116	-116	-116	-116	-116	-116
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	116	116	116	116	116	116	116
5.33%	232	232	232	232	232	232	232
8.00%	348	348	348	348	348	348	348
KR4A056A0007						2026-10 미니코스피200 선물	
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78
-5.33%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52
-2.67%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	26	26	26	26	26	26	26
5.33%	52	52	52	52	52	52	52
8.00%	78	78	78	78	78	78	78
KR4A226A0002 2026-10 삼성SDI개별선물							5

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
-5.33%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
-2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	2	2	2	2	2	2	2
5.33%	4	4	4	4	4	4	4
8.00%	5	5	5	5	5	5	5

KR4A416A0002 2026-10 SK이노베이션개별선물							5
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5	5	5	5	5	5	5
-5.33%	3	3	3	3	3	3	3
-2.67%	2	2	2	2	2	2	2
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
8.00%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

1,462

공시일	2026-09-30
기준일	2026-09-29

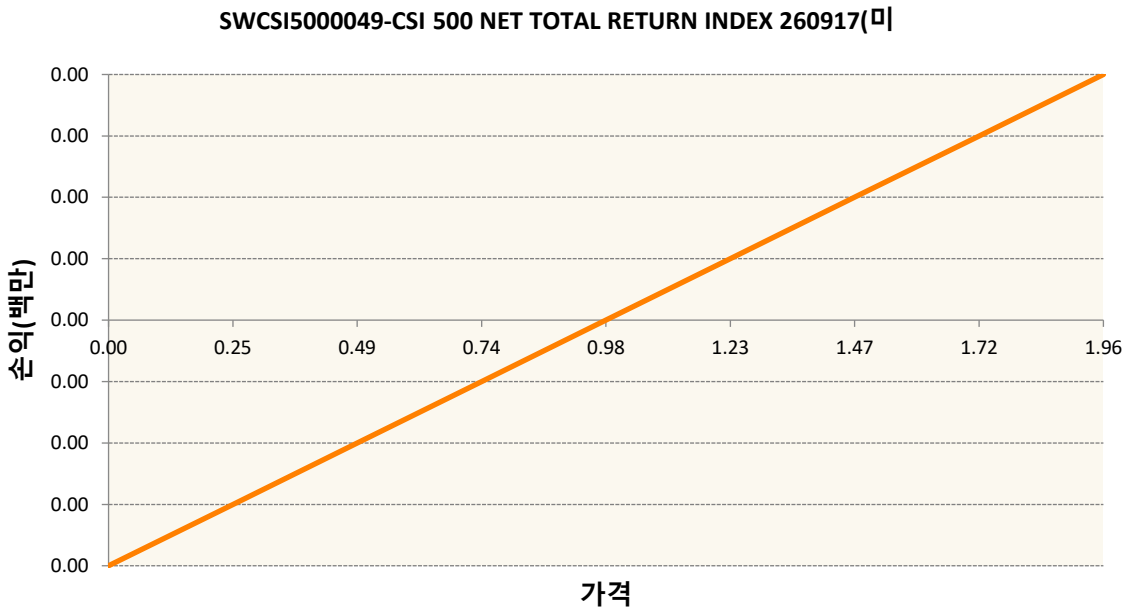
SOL차이나강소기업CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	5,214	0	5,214	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260917(미

417

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

665

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-09-30
기준일	2026-09-29

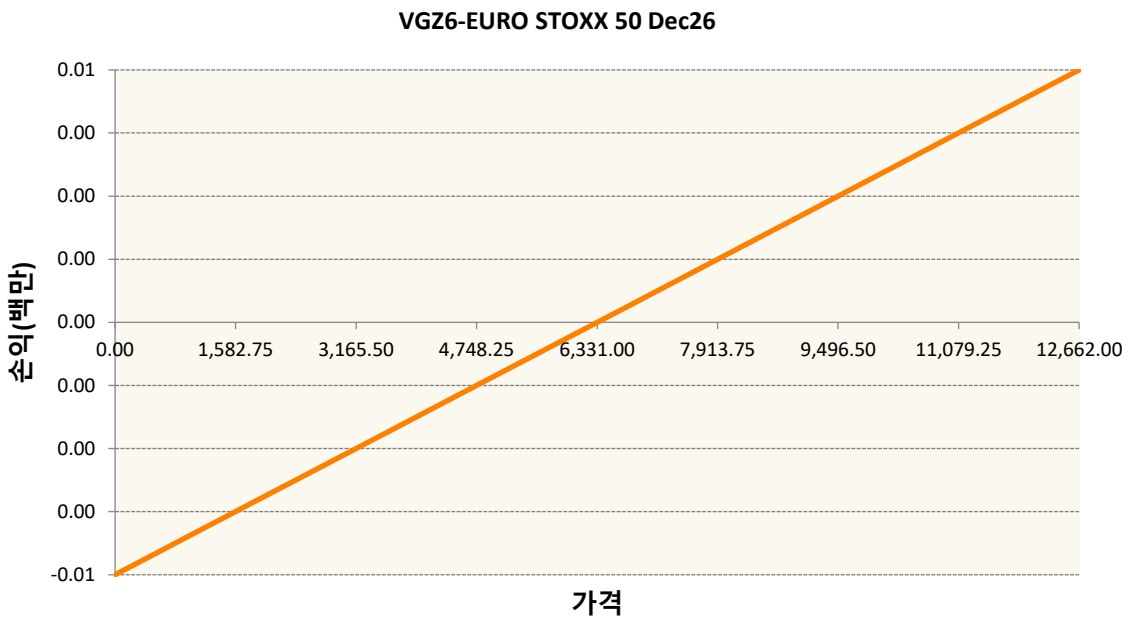
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,105	0	1,105	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ6	EURO STOXX 50 Dec26	88
------	---------------------	----

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

65

공시일	2026-09-30
기준일	2026-09-29

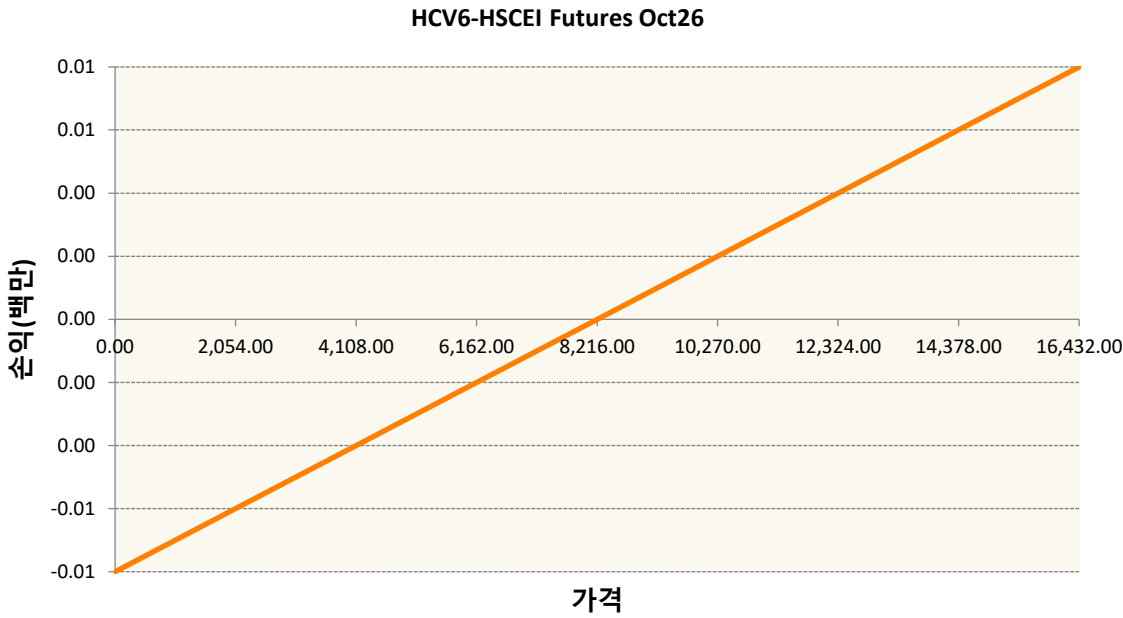
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,287	0	1,287	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCV6	HSCEI Futures Oct26	103
------	---------------------	-----

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

97

공시일	2026-09-30
기준일	2026-09-29

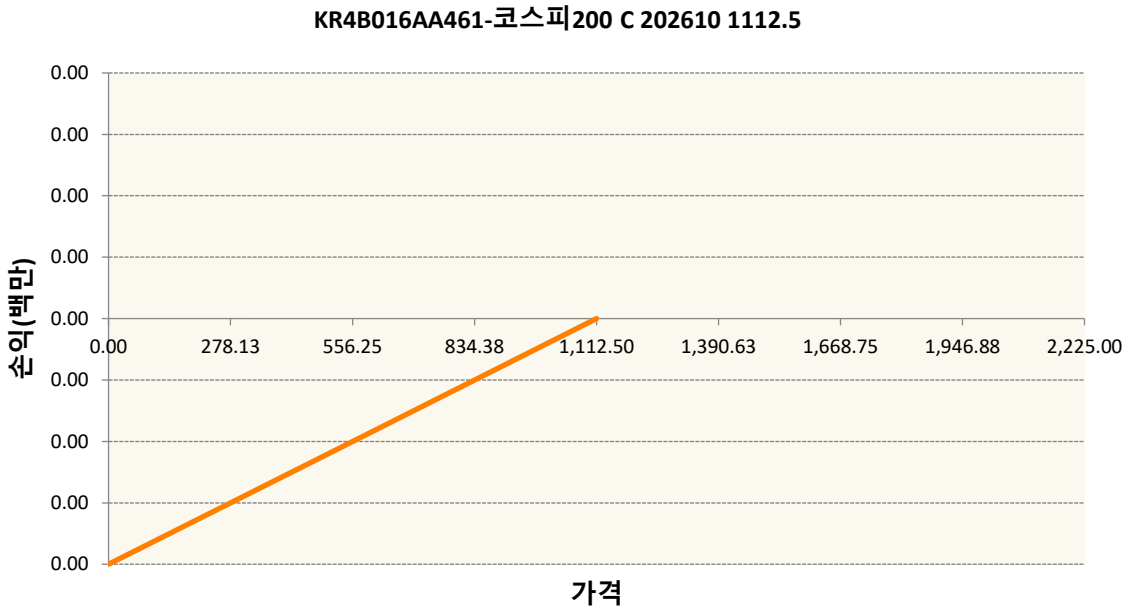
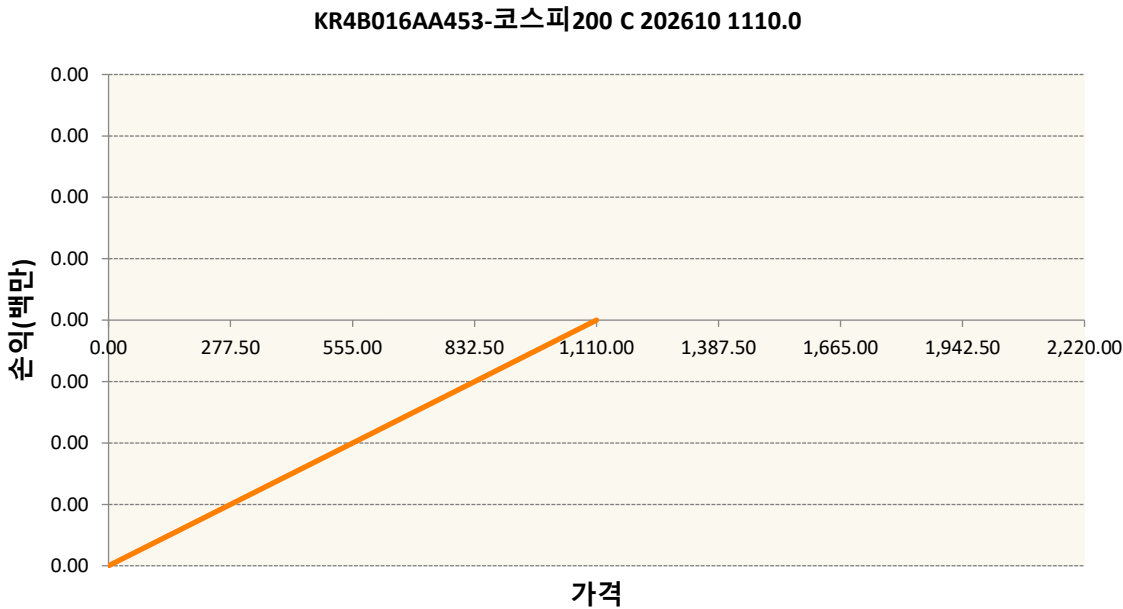
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

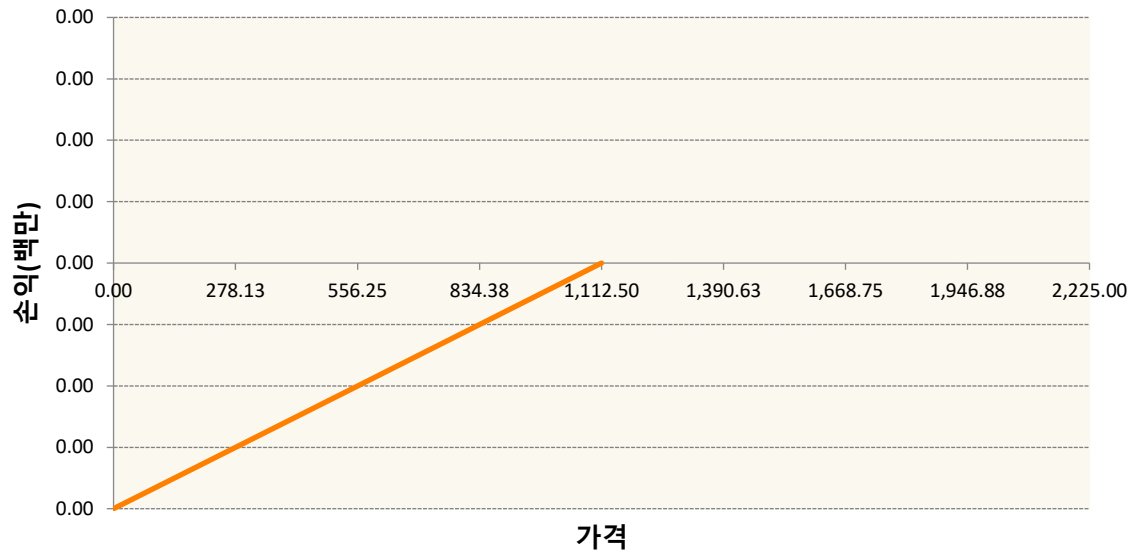
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	564	-564	장내
누계	유가증권	옵션	0	49,490	-49,490	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4C016AA460-코스피200 P 202610 1112.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4B016AA453 코스피200 C 202610 1110.0							462
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-428	-431	-435	-441	-447	-454	-462
-5.33%	-250	-257	-265	-274	-284	-294	-306
-2.67%	-87	-99	-112	-125	-139	-153	-167
0%	48	32	16	0	-16	-33	-49
2.67%	149	132	115	98	81	64	47
5.33%	214	199	184	169	153	137	121
8.00%	250	240	228	216	203	190	176
KR4B016AA461 코스피200 C 202610 1112.5							2,097
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,952	-1,965	-1,982	-2,005	-2,032	-2,062	-2,097
-5.33%	-1,145	-1,175	-1,210	-1,249	-1,293	-1,340	-1,390
-2.67%	-407	-459	-514	-572	-633	-695	-759
0%	215	144	72	0	-73	-146	-220
2.67%	681	605	528	451	374	297	220
5.33%	987	920	851	780	709	636	563
8.00%	1,161	1,112	1,059	1,002	943	881	817
KR4C016AA460 코스피200 P 202610 1112.5							627
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-584	-588	-593	-600	-608	-617	-627
-5.33%	-343	-351	-362	-374	-387	-401	-416
-2.67%	-122	-137	-154	-171	-189	-208	-227
0%	64	43	22	0	-22	-44	-66

2.67%	204	181	158	135	112	89	66
5.33%	295	275	255	233	212	190	168
8.00%	347	333	317	300	282	263	244

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

5,484

공시일	2026-09-30
기준일	2026-09-29

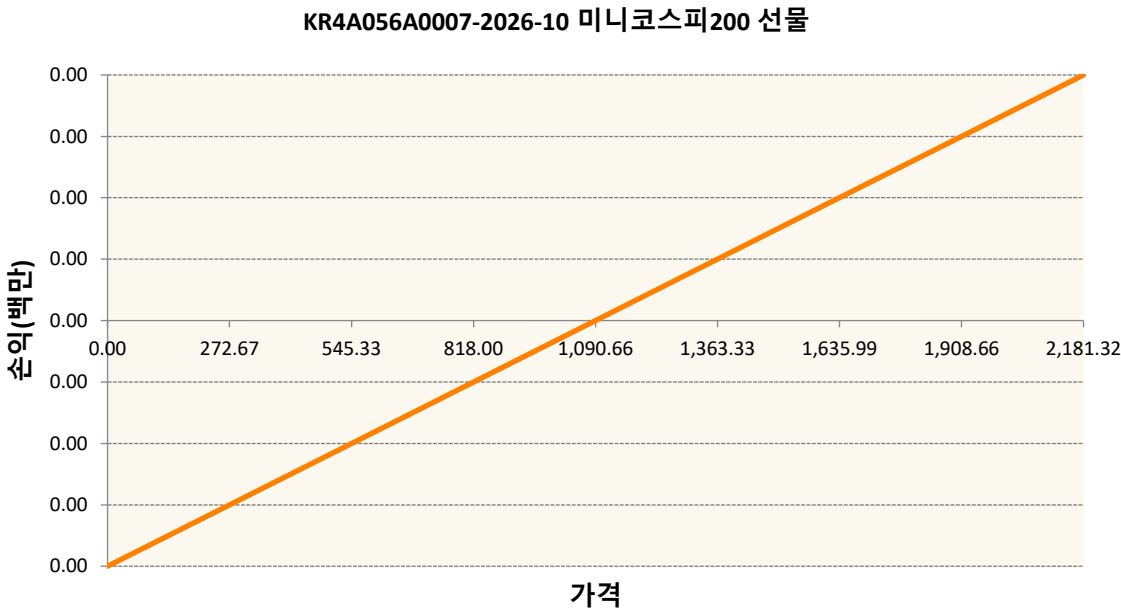
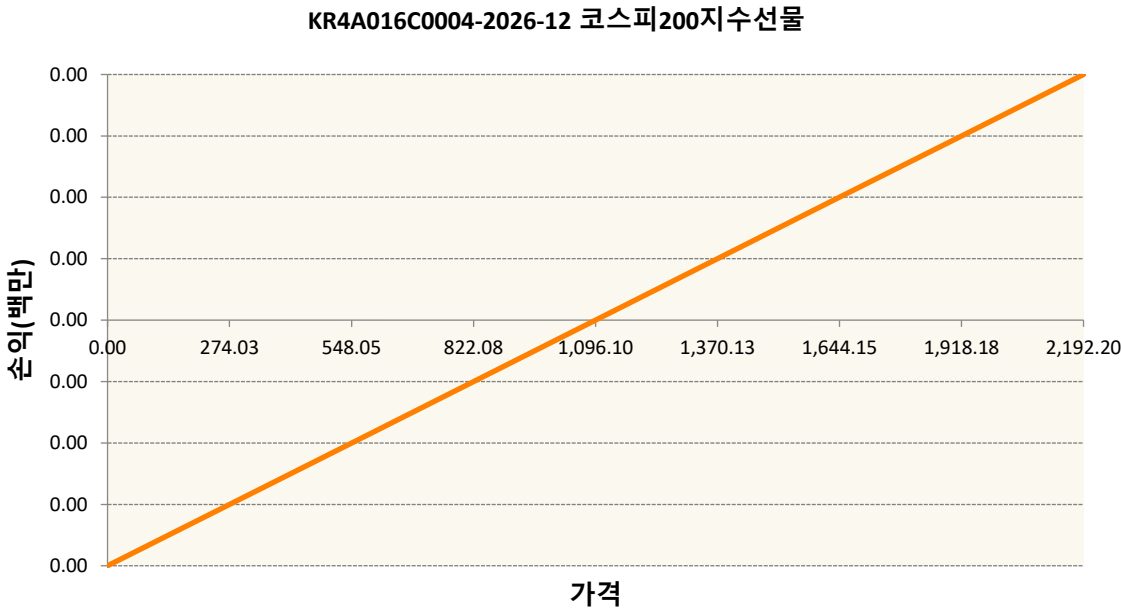
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

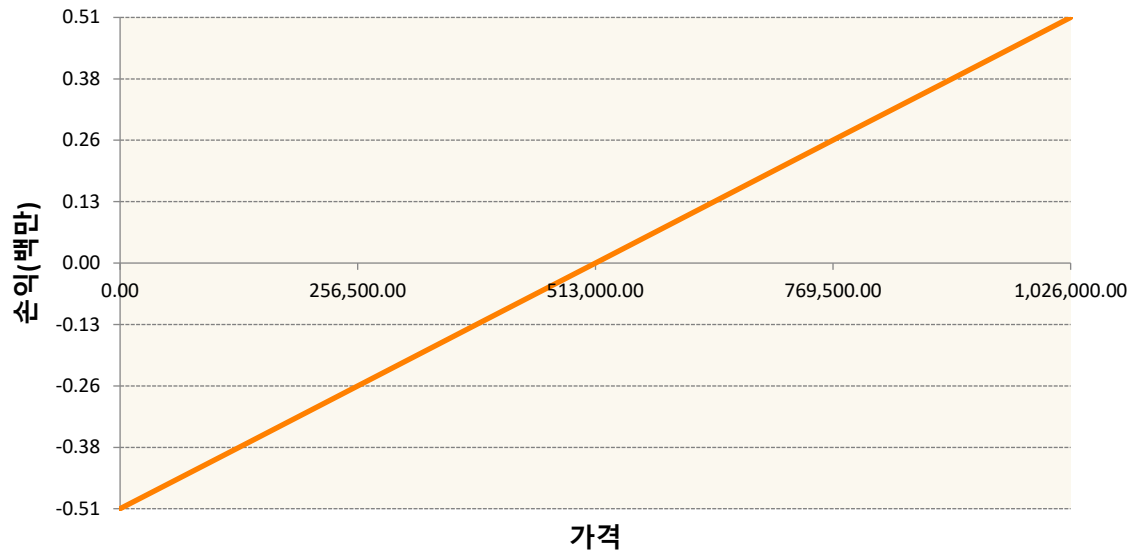
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	273	0	273	장내
누계	유가증권	선물	2,782	59	2,723	장내

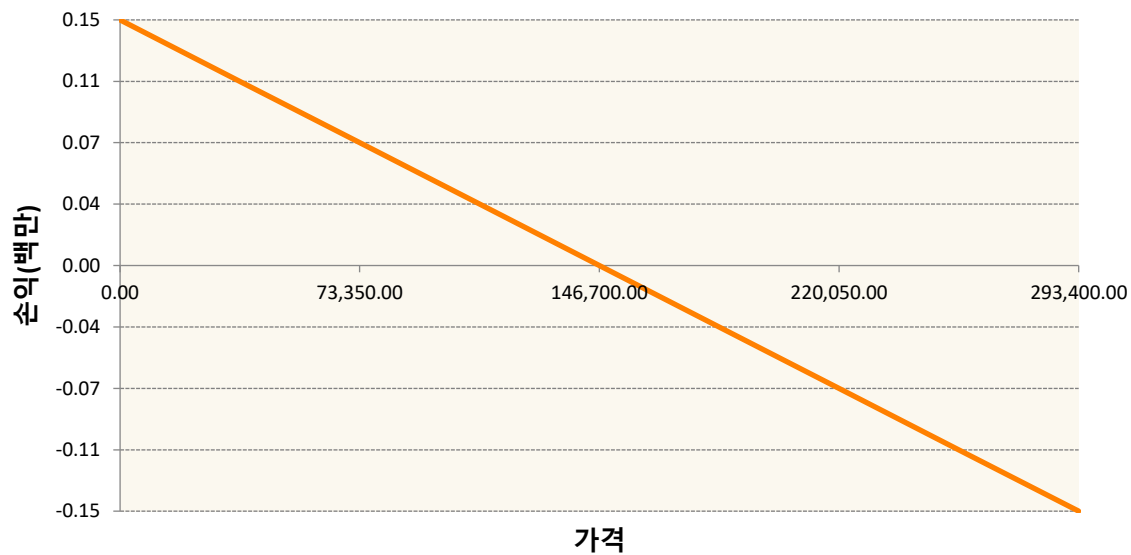
2. 만기시점의 손익구조



KR4A226A0002-2026-10 삼성SDI개별선물



KR4A416A0002-2026-10 SK이노베이션개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A016C0004		2026-12 코스피200지수선물					65
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65
-5.33%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44
-2.67%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	22	22	22	22	22	22	22
5.33%	44	44	44	44	44	44	44
8.00%	65	65	65	65	65	65	65
KR4A056A0007		2026-10 미니코스피200 선물					30
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30
-5.33%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20
-2.67%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	10	10	10	10	10	10	10
5.33%	20	20	20	20	20	20	20
8.00%	30	30	30	30	30	30	30

KR4A226A0002 2026-10 삼성SDI개별선물 4

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
-5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
-2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1	1	1	1	1	1	1
5.33%	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	4	4	4	4	4	4	4

KR4A416A0002 2026-10 SK이노베이션개별선물 5

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5	5	5	5	5	5	5
-5.33%	3	3	3	3	3	3	3
-2.67%	2	2	2	2	2	2	2
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
8.00%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

339

공시일	2026-09-30
기준일	2026-09-29

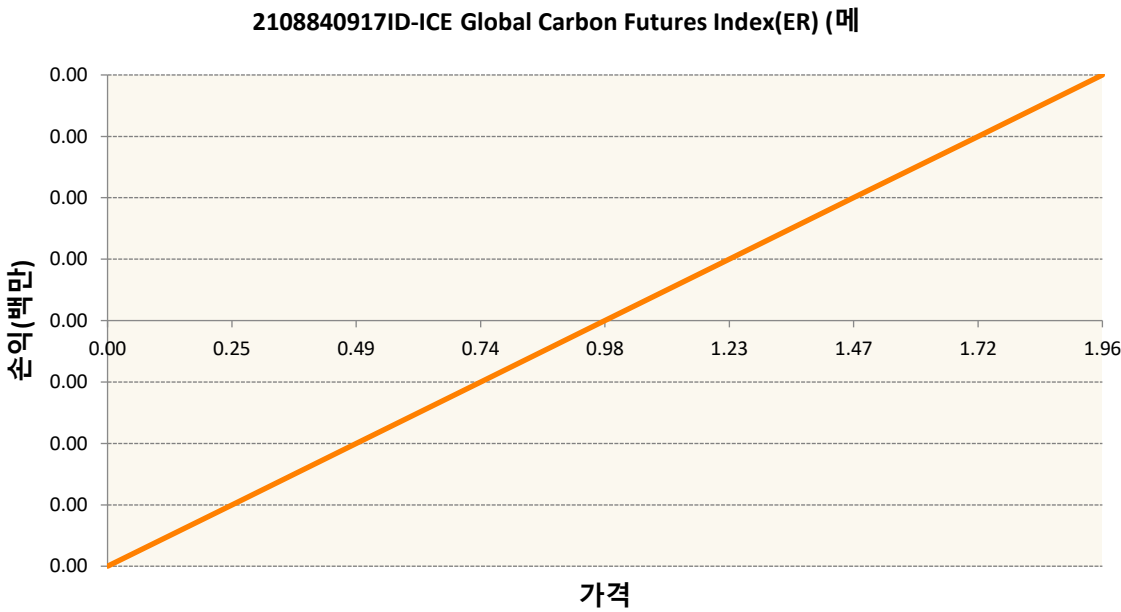
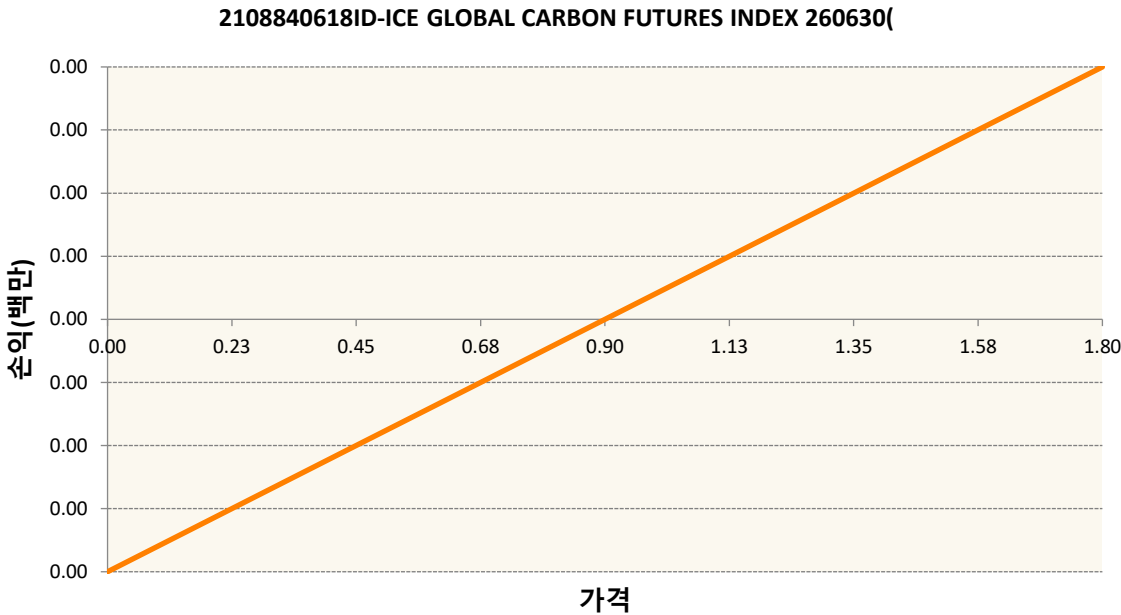
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	6,865	0	6,865	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840618IICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260630(		440
2108840917IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		111

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		576

공시일	2026-09-30
기준일	2026-09-29

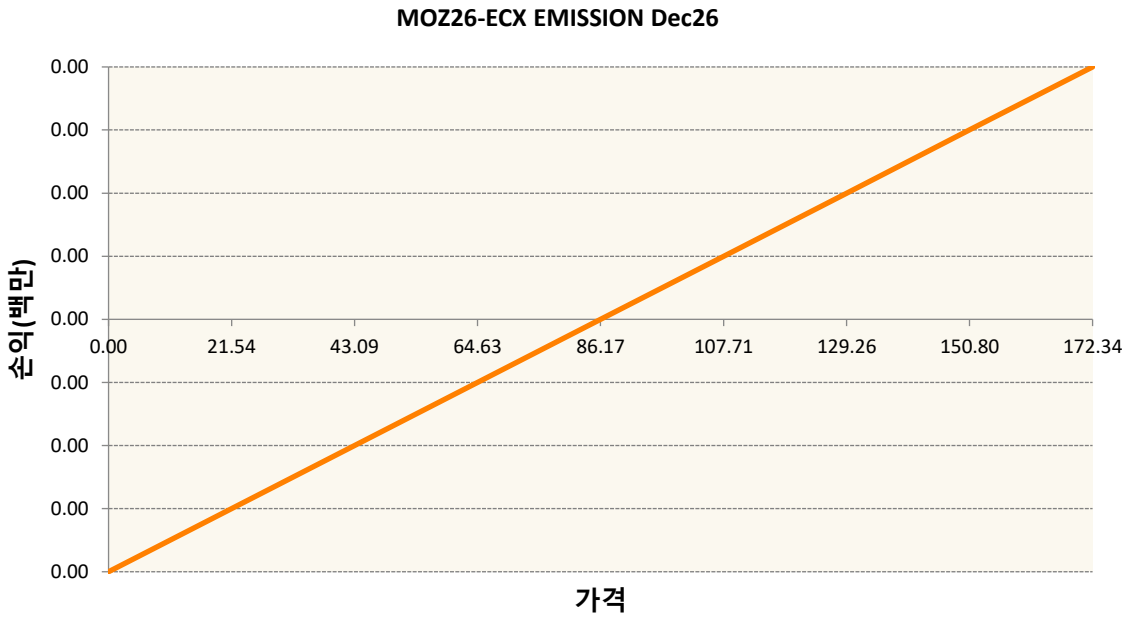
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규			0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계			6,090	0	6,090	
누계	통화	선도	0	5,119	-5,119	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G8V\ KRW/EUR 30-09-26E	205
FXW213G9V\ KRW/EUR 30-10-26E	205
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	487

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

868

공시일	2026-09-30
기준일	2026-09-29

신한SOL차이나태양광CSI증권상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	-314	0	-314	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(	4
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(N	4
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(	7
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260923(	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

41

공시일	2026-09-30
기준일	2026-09-29

SOL차이나육성산업액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	-3,077	0	-3,077	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	2
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260714(미래)	237
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260917(메리츠)	4

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

451

공시일	2026-09-30
기준일	2026-09-29

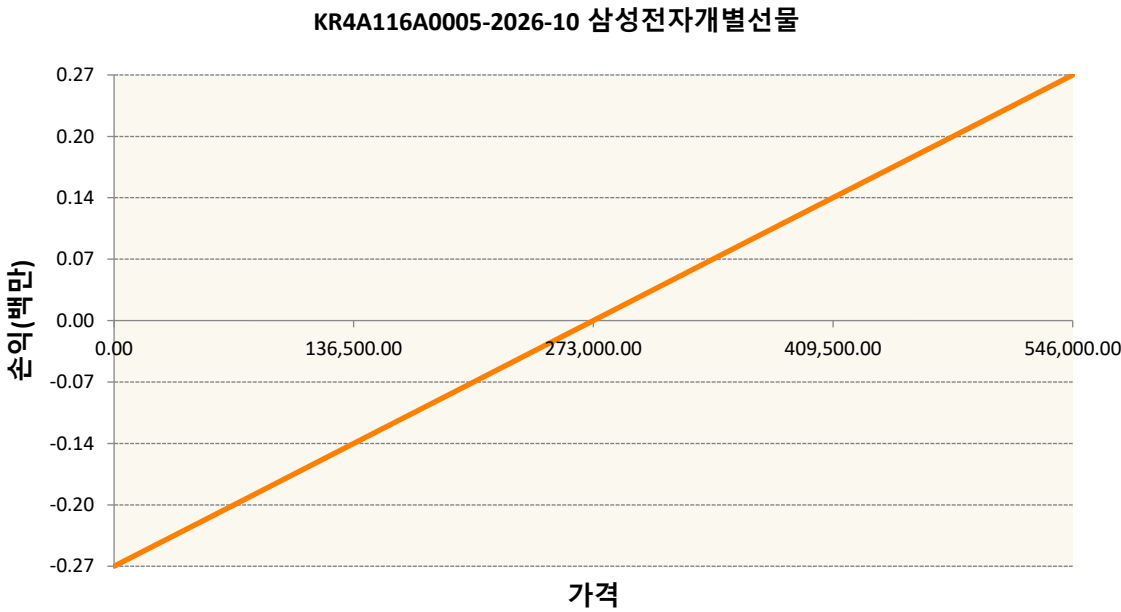
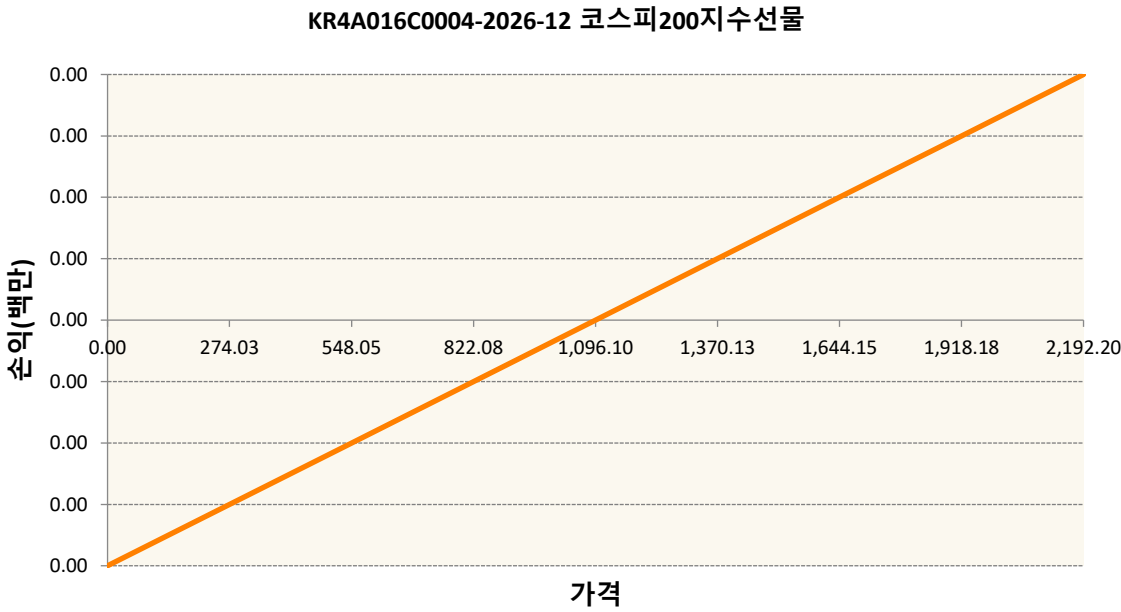
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

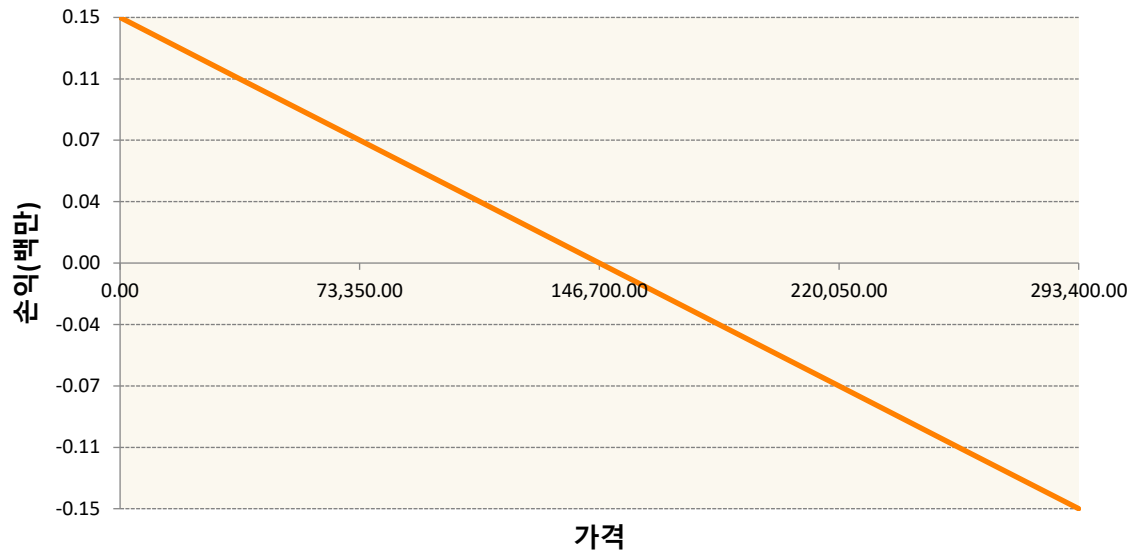
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,464	0	2,464	장내
누계	유가증권	선물	17,741	298	17,443	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4A416A0002-2026-10 SK이노베이션개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A016C0004			2026-12 코스피200지수선물				1,132
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,132	-1,132	-1,132	-1,132	-1,132	-1,132	-1,132
-5.33%	-754	-754	-754	-754	-754	-754	-754
-2.67%	-377	-377	-377	-377	-377	-377	-377
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	377	377	377	377	377	377	377
5.33%	754	754	754	754	754	754	754
8.00%	1,132	1,132	1,132	1,132	1,132	1,132	1,132
KR4A116A0005			2026-10 삼성전자개별선물				279
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-279	-279	-279	-279	-279	-279	-279
-5.33%	-186	-186	-186	-186	-186	-186	-186
-2.67%	-93	-93	-93	-93	-93	-93	-93
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	93	93	93	93	93	93	93
5.33%	186	186	186	186	186	186	186
8.00%	279	279	279	279	279	279	279
KR4A416A0002			2026-10 SK이노베이션개별선물				24
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	24	24	24	24	24	24	24
-5.33%	16	16	16	16	16	16	16
-2.67%	8	8	8	8	8	8	8
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8
5.33%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16
8.00%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

4,996

공시일	2026-09-30
기준일	2026-09-29

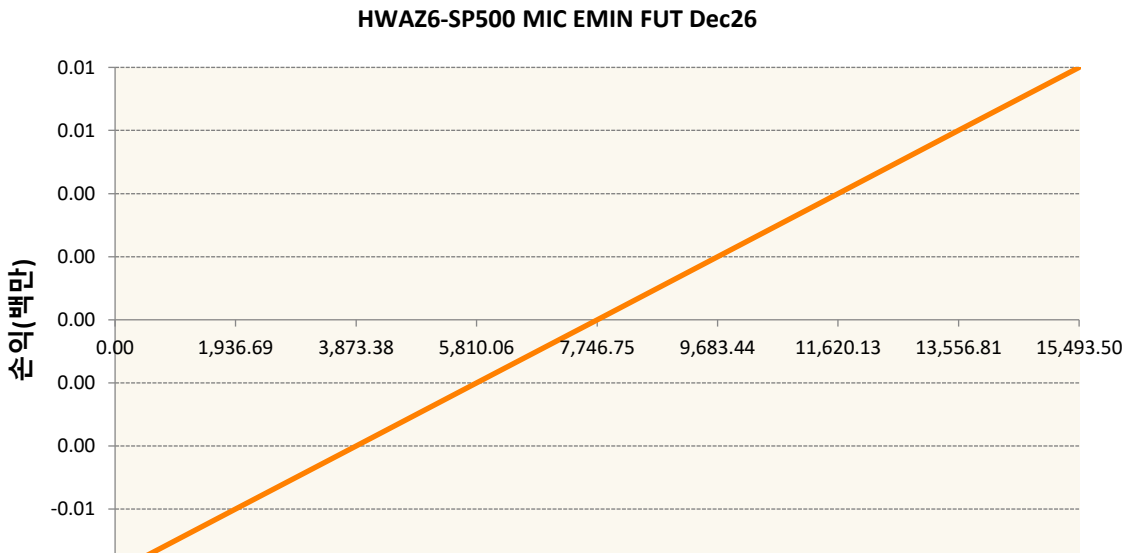
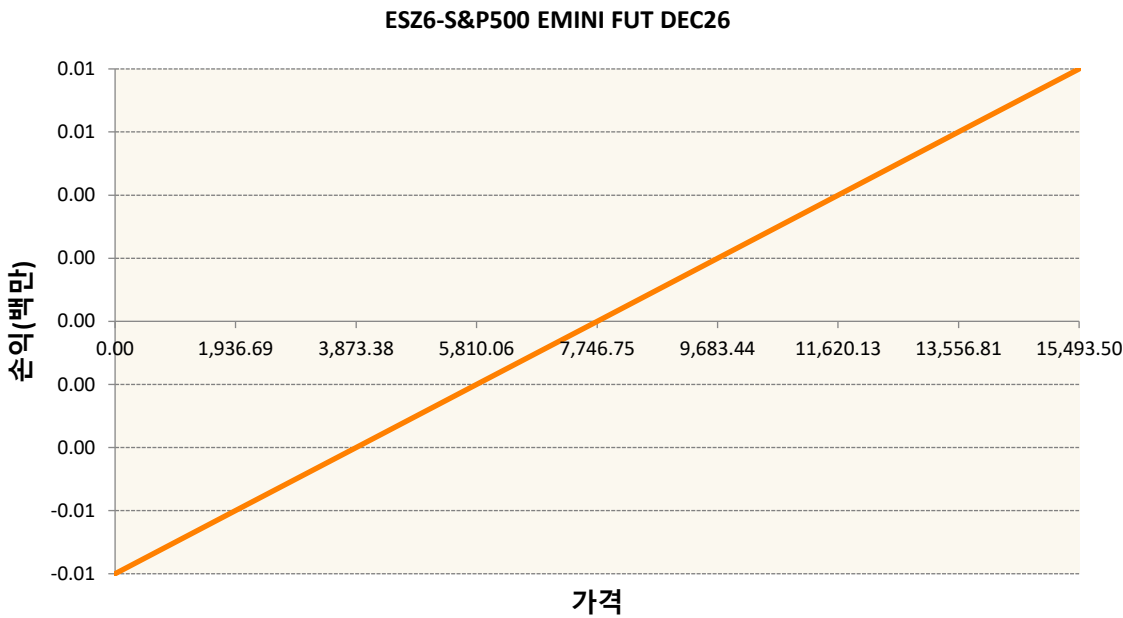
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

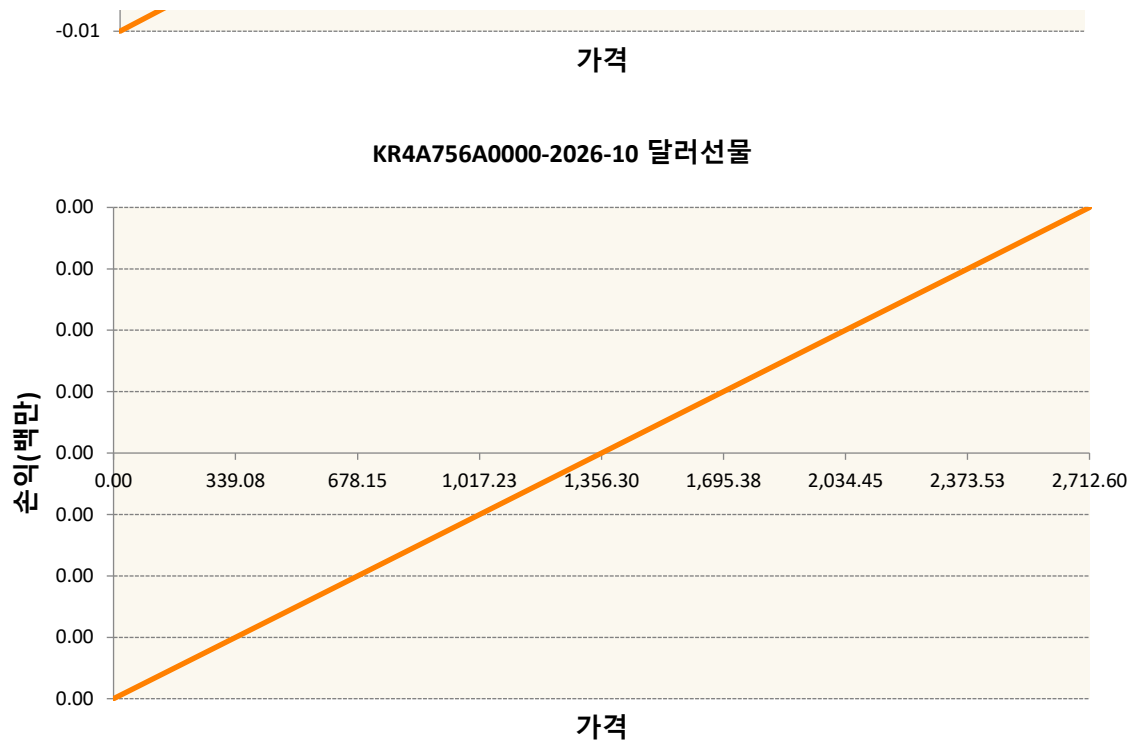
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
신규	지수	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	지수	선물	75,963	0	75,963	
누계	지수	선물	375	0	375	장내
누계	통화	선물	14,377	0	14,377	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESZ6	S&P500 EMINI FUT DEC26	6,077
HWAZ6	SP500 MIC EMIN FUT Dec26	30
KR4A756A0C	2026-10 달러선물	1,150

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

3,753

공시일	2026-09-30
기준일	2026-09-29

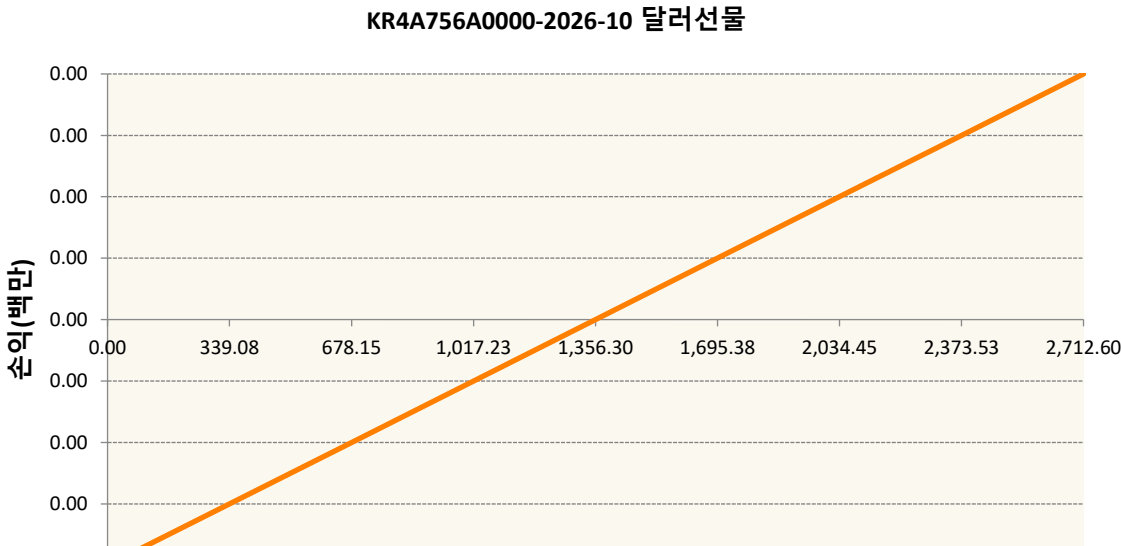
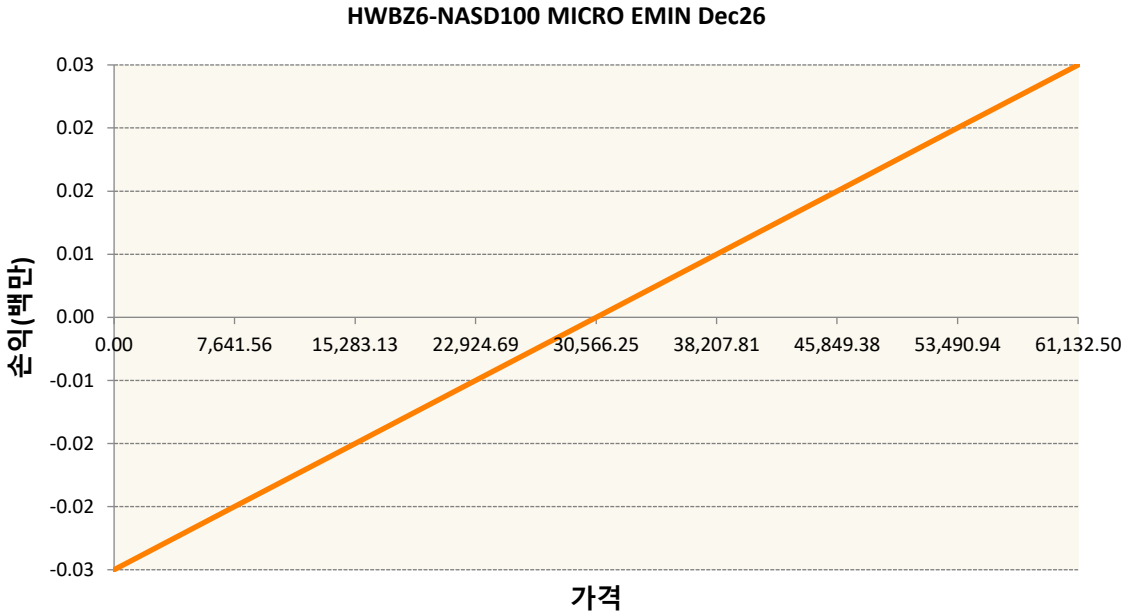
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

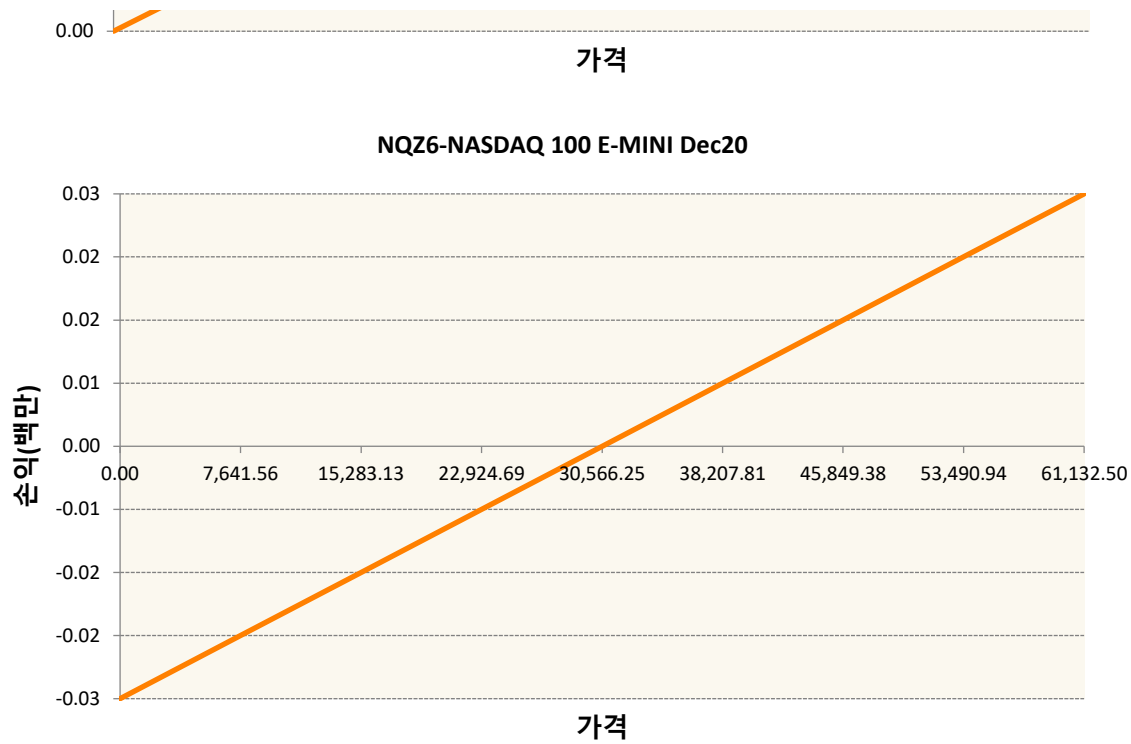
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
신규	지수	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	지수	선물	35,463	0	35,463	
누계	지수	선물	422	0	422	장내
누계	통화	선물	6,795	0	6,795	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HWBZ6	NASD100 MICRO EMIN Dec26	34
KR4A756A0C	2026-10 달러선물	544
NQZ6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	2,837

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

2,566

공시일	2026-09-30
기준일	2026-09-29

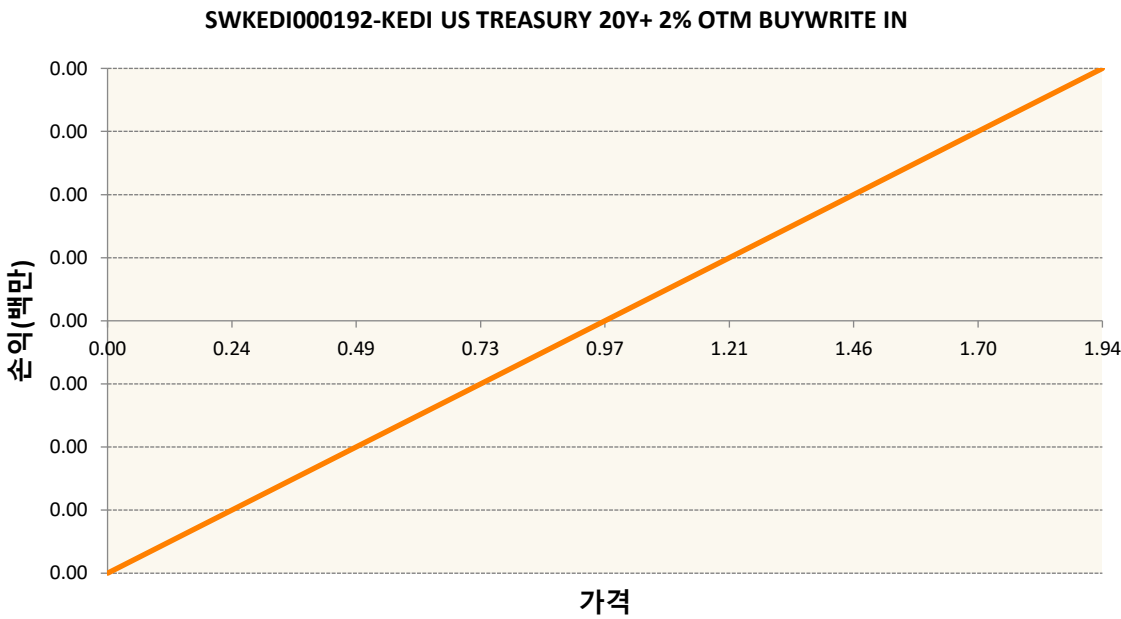
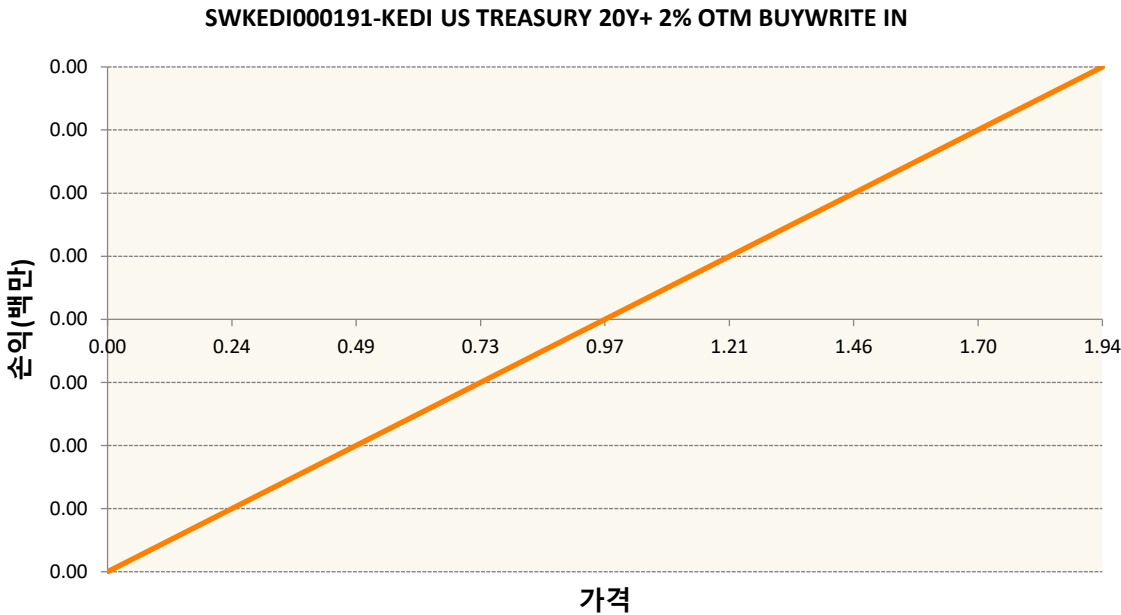
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

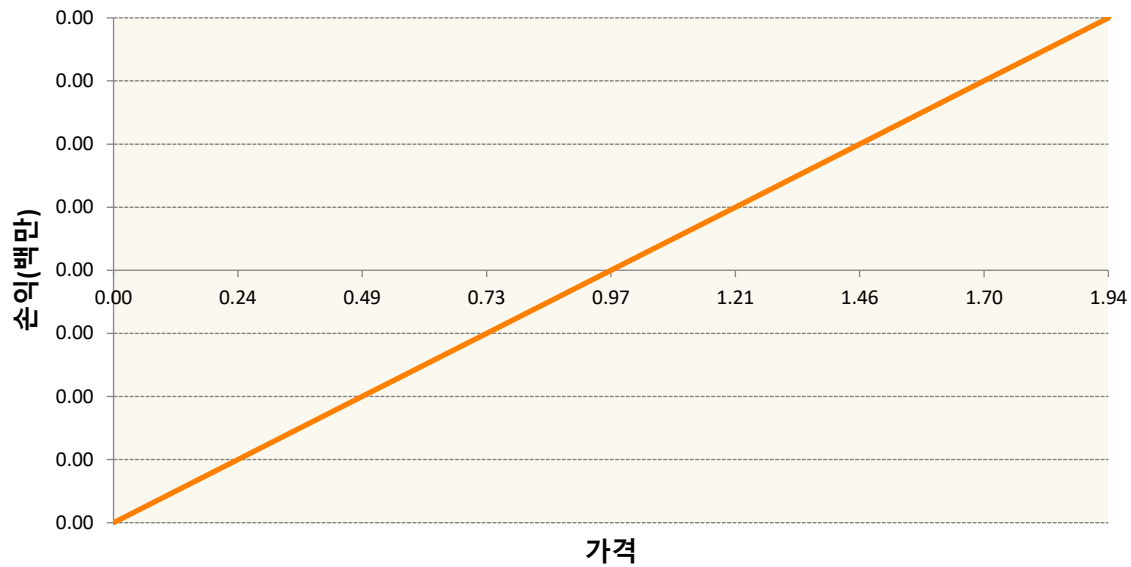
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	271,045	0	271,045	장외

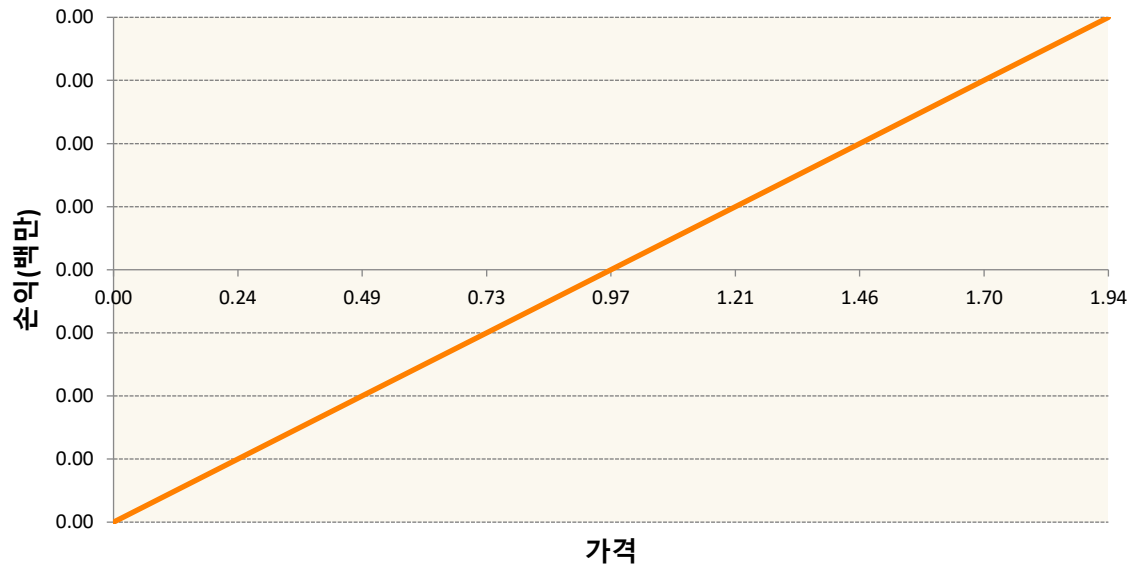
2. 만기시점의 손익구조



SWKEDI000193-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



SWKEDI000194-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,641
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	4,697
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,828
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,470

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

8,686
